



ICOAEF '18 IV.

INTERNATIONAL CONFERENCE ON
APPLIED ECONOMICS AND FINANCE
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

FULL PAPER PROCEEDING

28th-29th-30th NOVEMBER 2018
KUSADASI - TURKEY

ISBN NU: 978-605-68187-8-3



BANDIRMA
ONYEDİ EYLÜL
UNIVERSITY



SOCIAL SCIENCES
UNIVERSITY OF
ANKARA



BANDIRMA
BELEDİYESİ



Scopus®





ICOAEF '18 IV.

INTERNATIONAL CONFERENCE ON
APPLIED ECONOMICS AND FINANCE
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

Editors:

Prof. Burak DARICI- Bandırma Onyedi Eylül University, Turkey

Assoc. Prof. H.Murat ERTUĞRUL- Undersecretariat of Treasury, Turkey

Dr. Fatih AYHAN- Bandırma Onyedi Eylül University, Turkey

Assistants Of Editors:

Res. Ass. Şeyma ŞAHİN KUTLU- Bandırma Onyedi Eylül University, Turkey

PhD Student Melike ÇETİNBAKIŞ- Bandırma Onyedi Eylül University, Turkey



ORGANIZING COMMITTEE

Prof. Burak DARICI
Assoc. Prof. H. Murat ERTUĞRUL
Assoc. Prof. Derviş KIRIKKALELİ
Asst. Prof. Halis KIRAL
Asst. Prof. Fatih AYHAN
Asst. Prof. Ufuk BİNGÖL
Lec. Yasin Nuri ÇAKIR
Res. Asst. Şeyma ŞAHİN KUTLU
Melike ÇETİNBAKIŞ
Mustafa ÖZMEN

28th-29th-30th NOVEMBER 2018
KUSADASI - TURKEY



ICOAEF '18 IV.

INTERNATIONAL CONFERENCE ON
APPLIED ECONOMICS AND FINANCE
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

SCIENTIFIC COMMITTEE

Süleyman ÖZDEMİR (Bandırma Onyedi Eylül University / Rector)
Kerim ÖZDEMİR (Balıkesir University Rector)
Alpaslan SEREL (Bandırma Onyedi Eylül University)
Abbas Mirakhor (International Centre for Education in Islamic Finance, Malaysia)
Abdelfeteh Bitat (Universite Saint-Louis Bruxelles, Belgium)
Abdullah OKUMUŞ (İstanbul University)
Adim MAMUTİ (University of New York, Tirana, SUNY Empire State College)
Adel Alaraifi (University of Dammam, Saudi Arabia)
Ahmet AY (Selçuk University)
Ahmet AYDIN (Bandırma Onyedi Eylül University)
Ahmet İNCEKARA (İstanbul University)
Ahmet YÖRÜK (Kadir Has University)
Aktham Issa Al-Magaireh (United Arab Emirates University, United Arab Emirates)
Alaa Alaabed (Islamic International Rating Agency)
Alessandro Belmonte (IMT School for Advanced Studies Lucca, Italy)
Alex Petersen (the University of California, USA)
Alexandru Minea (University of Auvergne, France)
Ali Alp (TOBB University of Economics and Technology, Turkey)
Alpay Kocak (TUIK, Turkey)
Alper Özün (University of Oxford, UK)
Andrea Flori (IMT School for Advanced Studies Lucca, Italy)
Anil K. Bera (University of Illinois, USA)
Antonio Rodriguez Andres (Technical University of Ostrava, Czech Republic)
Ashraf Imam (University of Dammam, Saudi Arabia)
Aybeniz Akdeniz AR (Bandırma Onyedi Eylül University)
Ayhan ORHAN (Kocaeli University)
Aziz Turhan (Banking Regulation and Supervision Agency, Turkey)
Bülent Güloğlu (Istanbul Technical University, Turkey)
Burçhan Sakarya (Republic of Turkey Ministry of Development)
Carlo Del Mašo (BTO Research, Italy)
Cemil ERTUĞRUL
Cevdet AVCIKURT (Balıkesir University)
Charalambos Pitros (University of Salford, United Kingdom)
Christian Richter (University of Bedfordshire Business School, UK)
Clayton W. BARROWS (University of New Hampshire, USA)
Cüneyt AKAR (Bandırma Onyedi Eylül University)
Deniz Şişman (Gelişim University, Turkey)
Dilvin Taskin (Yasar University, Turkey)
Djula Borozan (University of Osijek, Croatia)
Dominic Spengler (University of York, UK)
Stefano SIVIERO (Bank of Italy)

Draeme Walsh (Bank of Ireland, UK)
Edip ÖRÜCÜ (Bandırma Onyedi Eylül University)
Emi Ferra (IMT School for Advanced Studies Lucca, Italy)
Emre Atilgan (Trakya University, Turkey)
Ercan EREN (Yıldız Teknik University)
Ercan Saridogan (Istanbul University, Turkey)
Erdal Tanas KARAGÖL (Yıldırım Beyazıt University)
Erdoğan KOÇ (Bandırma Onyedi Eylül University)
Ertan DEMİRKAPI (Bandırma Onyedi Eylül University)
Fatih MANGIR (Selcuk University)
Ferhun Ateş (Bank of China Turkey A.Ş. - Internal Control and Compliance Director)
Gökhan ORHAN (Bandırma Onyedi Eylül University)
Hafez Abdo (University of Nottingham, UK)
Halil İbrahim AYDIN (Batman University)
Hasan Aydın OKUYAN (Bandırma Onyedi Eylül University)
İlhan Bora (Cyprus Science University, North Cyprus)
Ivanka Nestoroska (Kliment Ohridski University, Macedonia)
Jan Černohorský (University of Pardubice, Czech Republic)
Jasmin Hosu (American University, USA)
Jean ANDREI Petroleum (Gas University of Ploiesti)
Kemal YILDIRIM (Anadolu University)
Kerem ALKİN (Medipol University)
Khaled Al Falah (University of Dammam, Saudi Arabia)
Khalid Abdulrahman Al Falah (University of Dammam, Saudi Arabia)
Kosta Josifidis (University of Novi Sad, Editor of Panoeconomicus, Serbia)
Lazar Stosic (Editor in Chief, IJCRSEE, Serbia)
Liang Peng (Penn State University, USA)
Małgorzata Renigier-Biłozor (University of Warmia and Mazury, Poland)
Mansour AlShamali (Public Authority for Applied Education and Training, Kuwait)
Martin Hnízdo (University of Pardubice, Czech Republic)
Maurizio D'amato (Technical University of Politecnico di Bari, Italy)
Mehmet Ali Soytaş (Ozyegin University, Turkey)
Mehmet Emin ERÇAKAR (Bandırma Onyedi Eylül University)
Mehmet Şişman (Marmara University, Turkey)
Micheal Scroeder (Centre for European Economic Research, Germany)
Mirjana Radman Funaric (Polytechnic in Pozega, Croatia)**Sergius Koku (Florida Atlantic University/South East European University)**
Muhammad Kashif (Business School, GIFT University Pakistan)
Musa GÖK (İzmir Demokrasi University)
Mustafa DELİCAN (İstanbul University)
Muzaffer Ercan YILMAZ (Uludağ University)
Nilgun Caglar Irmak (Anadolu University, Turkey)
Nizar Yousef Naim (Ahlia University, Kingdom of Bahrain)
Noorsidi Aizuddin Bin Mat Noor (Universiti Teknologi Malaysia, Malaysia)
Omokolade Akinsomi (University of the Witwatersrand, South Africa)
Ong Seow Eng (National University of Singapore, Singapore)
Özgür BİYAN (Bandırma Onyedi Eylül University)
Paloma Taltavull de La Paz , (University of Alicante , Spain)
Paul Alagidede (University of the Witwatersrand, South Africa)
Pejman Bahramian (Girne American University, Cyprus)
Ramazan Sarı (METU, Turkey)
Rangan Gupta (University of Pretoria, South Africa)
Rıza ARSLAN (Bandırma Onyedi Eylül University)
Rodolfo Metulini (Universita Degli Studi di Brescia, Italy)
Sait KAYGUSUZ (Uludağ University)
Salem Nechi (Qatar University, Qatar)
Samson O. Fadiya (Editorial Advisory Board, IJCRSEE, North Cyprus)

Selçuk KOÇ (Kocaeli University)
Sema YILMAZ GENÇ (Kocaeli University)
Seyed Alireza Athari (Girne American University, Cyprus)
Serap ALTUNTAŞ (Bandırma Onyedi Eylül University)
Serap PALAZ (Bandırma Onyedi Eylül University)
Seyed Alireza Athari (Girne American University, North Cyprus)
Shekar Shetty (Gulf University for Science & Technology, Kuwait)
Siti Muawanah Lajis (Bank Negara Malaysia)
Snežana Todosijević - Lazović (University of Priština, R. Kosovo)
Steven Seggie (ESSEC Business School)
Stanislav Tkachenko (St. Petersburg State University, Russia)
Süleyman YÜKÇÜ (Dokuz Eylül University)
Suna KORKMAZ (Bandırma Onyedi Eylül University)
Sürhan CAM (Cardiff University)
Tekin AKGEYİK (İstanbul University)
Uğur Emek (Başkent University, Turkey)
Ugur Soytas (METU, Turkey)
Ünal Seven (TCMB, Turkey)
Vedat Yorucu (Vice President, Cyprus Turkish Economic Association)
Wool Shin (Samsung Group, Korea)
Yener Coşkun (Capital Markets Board of Turkey)
Yılmaz ÖZKAN (Sakarya University)
Zehra CİVAN (Vakıfbank, Turkey)
Zekai ÖZDEMİR (İstanbul University)
Zeki PARLAK (Marmara University)
Zeynep YÜCEL (Bandırma Onyedi Eylül University)
Zoran Katanic (High School of Economics Peć in Leposavić, R. Kosovo)



ICOAEF '18 IV.

INTERNATIONAL CONFERENCE ON
APPLIED ECONOMICS AND FINANCE
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

WELCOME MESSAGE ON BELALF OF THE CONFERENCE ORGANISING COMMITTEE OF ICOAEF'18

We are glad that International Conference on Applied Economics and Finance & Extended with Social Sciences gathered a large number of successful academics and professionals in Kusadasi-Aydin, Turkey.

255 papers were admitted and presented to ICOAEF'18 from 25 different countries and 126 different university and institutions. This conference provided as a suitable platform for discussions about the papers. The conference full paper proceeding contains 103 full paper.

We appreciated to our conference organising team because of their enormous performance for preparing such an important organisation. We also appreciated to all keynote speakers who shared their experiences and precious knowledge and encouraged to fruitful discussions.

We also would like to thank our sponsors who provided us financial support and conference materials. It would not be possible to organise this conference without their support. Our sponsors are The Central Bank of Turkish Republic, Bandirma Municipality, Bandirma Onyedi Eylul University, Ankara Social Sciences University, Ulakbim and Econlit.

Finally, we would like to thank our esteemed ICOAEF'18 participants who shared their deep knowledge and experience at ICOAEF'18. We wish to be together in our following organizations

On behalf of Conference Organisation Committee

Prof. Burak DARICI

Assoc.Prof. H.Murat ERTUGRUL

Assoc.Prof. Dervis KIRIKKALELI

Asst.Prof. Halis KIRAL

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES
November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

TABLE OF CONTENTS

| NU. | Title of Paper Author(s) | Page |
|------------|---|-------------|
| 1. | Sosyal Medyanın Tüketicilerin Satın Alma Niyeti Üzerine Etkisi: Üniversite Öğrencileri Üzerine Bir Model Önerisi <i>Ahmet Uyar</i> | 1 |
| 2. | Küresel Krizlerin Gelişmekte Olan Ülkelerde Yoksulluğa Etkisi <i>Sumru Bakan, Onur Akkaya</i> | 14 |
| 3. | Öz Kendilik Değerlendirmesinin Presenteeism Üzerinde Etkisinde Çalışmaya Tutkunluğun Aracılık Rolü <i>Ali Acaray</i> | 27 |
| 4. | Psikolojik İyi Oluşun İş Performansı Üzerindeki Etkisinde Örgüt Temelli Özsaygı ve Çalışmaya Tutkunluğun Aracılık Rolü <i>Ali Acaray</i> | 36 |
| 5. | Finansal Sağlık Skoru Endeksi: TR90 Bölgesi Pilot Uygulaması <i>Alper Veli Çam, Hasan Ayaydın, Büşra Tosunoğlu, Gül Yeşilçelebi, Fatih Akdeniz</i> | 47 |
| 6. | The Origin of the Fluctuations in Macroeconomic Indicators in Algeria <i>Attouchi Manel, Dahmani Mohammed Adrriouche</i> | 65 |
| 7. | Paracacık Sürü Optimizasyonu ile Portföy Optimizasyonu: Borsa İstanbul Ulaştırma Sektörü Hisseleri Üzerine Bir Uygulama <i>Burcu Adıgüzel Mercangöz</i> | 79 |
| 8. | İş Stresi, Meslektaş İlişkileri ve Bireysel Performans İlişkileri: Lojistik Sektöründe Bir Araştırma <i>Burcu Özge Özaslan Çalışkan</i> | 97 |
| 9. | The Relationship between Intrapreneurship and Change Management <i>Bülent Güven</i> | 105 |
| 10. | Could Economic Growth be A Solution to Environmental Pollution? New Evidence from A Panel Smooth Transition Regression Model <i>Celil Aydın, Ömer Esen</i> | 120 |
| 11. | Environment Kuznets Curve for Deforestation: New Evidence from A Panel Smooth Transition Regression Approach <i>Celil Aydın, Ömer Esen</i> | 127 |
| 12. | Enerji Vadeli İşlem Fiyatları ile Döviz Kurları Arasındaki İlişki: ARDL Yaklaşımı <i>Çağatay Başarır</i> | 136 |
| 13. | Water Shortage in Central Asia: Turkmenistan and Kazakhstan <i>Demet Şefika Mangır, Guncha Kerimkulyyeva</i> | 145 |
| 14. | United States' Foreign Policy Towards Central Asia | 145 |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | <i>Demet Şefika Mangır, Mukhammadjon Ganiev</i> | |
|-----|--|-----|
| 15. | Türkiye’de İller Düzeyinde Sektörel Kamu Yatırımları ile İhracat Arasındaki Eşbütünleşik İlişkiler <i>Burcu Türkcan</i> | 163 |
| 16. | Housing Policies and Decision-Making in Urban Planning Process of Turkey and Russia <i>Elmira Nizamova, Asuman Türkün</i> | 173 |
| 17. | Simetrik ve Asimetrik Koşullu Değişen Varyans Modelleri ile Volatilité Tahmini: Borsa İstanbul 100 Endeksi Uygulaması <i>Emre Esat Topalođlu, Serdar Yaman</i> | 186 |
| 18. | Eđitim ve Yoksulluk İlişkisi <i>Erdal Tanas Karagöl, Didem Koca, Büşra İlgün</i> | 205 |
| 19. | Sosyal Yardım Uygulamalarında Farkındalık Oluşturulması ve Sosyal Katılımcılıđın Arttırılması <i>Erdal Tanas Karagöl, Esat İpek</i> | 218 |
| 20. | Türkiye ve Rusya Arasındaki Bölgesel Enerji İş Birliklerinin Bugünü ve Geleceđi <i>Erdal Tanas Karagöl, Esat İpek</i> | 227 |
| 21. | Festivallerin Etkilerine Yönelik Çalışmaların İncelenmesi <i>Eylin Aktaş, Seher Ceylan, Nuray Selma Özdişçiner</i> | 240 |
| 22. | Destinasyon Marka Denkliđinin Turist Memnuniyeti ve Yeniden Ziyaret Niyetine Etkisi: Eskişehir Örneđi <i>Eylin Aktaş</i> | 257 |
| 23. | Financial Sector Development and Economic Growth in Algeria: An ARDL Analysis 1980-2017 <i>Fahsı Zineb, Djabri Fatima Zahra</i> | 268 |
| 24. | Rekabet Avantajı Sağlamada Deđer Zinciri Analizinin Sağlık Hizmetlerindeki Rolü <i>Fatih Orhan, Fırat Seyhan, Fatih Ayhan</i> | 281 |
| 25. | Sukuk İhracının Hisse Senedi Getirilerine Etkisi: Örnek Banka Üzerinde Bir Olay Çalışması <i>Gamze Göçmen Yağcılar, Zühal Arslan</i> | 295 |
| 26. | A Time-Series Analysis of Real Wages-Employment Relationship in Turkish Manufacturing Industry <i>Hacer Simay Karaalp-Orhan</i> | 311 |
| 27. | The Employment Intensity of Growth: A Sectoral Analyses for Turkey <i>Hacer Simay Karaalp-Orhan</i> | 320 |
| 28. | Finansal Okuryazarlık Düzeyinin Belirlenmesi için Cođrafî Ağırlıklı Regresyon Yönteminin Uygulanması <i>Üstün Özen, Handan Çam, Fulya Aslay, Alper Veli Çam</i> | 329 |
| 29. | Tüketicilerin Yabancı Markalarla Duygusal Bağları: Düşmanlık, Hayranlık ve Etnosentrizm <i>Hatice Aydın, Sevtap Ünal</i> | 341 |
| 30. | Üniversite Öğrencilerinin Ürün ve Markalara Yönelik İnsan Biçimselleştirme Algıları: Fenomenolojik Bir Araştırma <i>Hatice Aydın, Sevtap Ünal</i> | 350 |

| | | |
|-----|---|-----|
| 31. | Makro Açıdan Çevresel Politikaların Atık Yaratma Üzerindeki Etkisinin Panel Veri Analizi ile Ölçülmesi: Seçilmiş Oecd Ülkeleri Üzerine Bir Analiz <i>Hüseyin Önder</i> | 359 |
| 32. | The Political Determinants of Transport Funding: An Examination of the United States <i>İsmail Çağrı Özcan</i> | 373 |
| 33. | Enflasyon ve Dış Ticaretin İşsizlik Üzerine Etkisi: Türkiye Uygulaması (2008-2018) <i>Hüseyin Güvenoğlu</i> | 381 |
| 34. | Turizmde Örgütsel Davranış Çalışmaları: Adım Üniversiteleri'nde Tamamlanan Lisansüstü Tezler Üzerine Bibliyometrik Bir Araştırma <i>İşıl Arıkan Saltık, Çağla Alımanoğlu</i> | 394 |
| 35. | Enflasyon ve İktisadi Büyümenin Kredi Risk Primi (CDS) Üzerindeki Etkisi: Brics Ülkeleri ve Türkiye Örneği <i>Mustafa Kırca, Füsün Çelebi Boz, Ümit Yıldız</i> | 407 |
| 36. | Makroekonomik Faktörlerin Farklı Ülke Gruplarından Gelen Turist Sayıları Üzerindeki Etkisinin İncelenmesi: Türkiye Üzerine Bir Uygulama <i>M.Oğuzhan İlban, Sevgi Sezer, M.Tahsin Liceli</i> | 420 |
| 37. | Reel Döviz Kurunun Farklı Ülke Gruplarından Gelen Turist Sayıları Üzerindeki Etkisinin İncelenmesi: Türkiye Üzerine Bir Uygulama <i>M.Oğuzhan İlban, Sevgi Sezer, M.Tahsin Liceli</i> | 439 |
| 38. | The Analysis for the Validity of Efficiency and Compensation Hypothesis in Euro Area: Evidence from Panel Data Analysis <i>Fatih Mangır, Fatih Ayhan</i> | 456 |
| 39. | Alt İşveren Çalışanları Perspektifinden, Yöneticilerin İş Güvenliğine Bağlılığı Düzeylerinin İncelenmesi: Belediye Çalışanları Örneği <i>Bülent Arpat</i> | 467 |
| 40. | Meslek Yüksekokullarında Uygulanan İşbaşı Eğitimlerinde Yaşanan Sorunlar ve Çözüm Önerileri <i>Bülent Arpat</i> | 473 |
| 41. | Meslek Yüksekokullarında Verilen Girişimcilik Derslerinin Girişimcilik Eğilimine Etkisi Üzerine Boylamsal Bir Araştırma <i>Bülent Arpat, Yeliz Yeşil, Mehmet Levent Kocaalan</i> | 479 |
| 42. | Makroekonomik Göstergelerin CDS Primini Açıklama Gücü: Kırılgan Beşli Ülkeleri İçin Bir Panel ARDL Analizi <i>Bünyamin Ekrem, İsmail Çeviş, Reşat Ceylan, Nihal Yayla</i> | 490 |
| 43. | Relationship between Financial Literacy and Financial Self-Efficacy: A Research on University Students <i>Dilek Demirhan, Özgür Babacan, Ahmet Rutkay Ardoğan, Ceren Tatarlar</i> | 509 |
| 44. | The Effect of Human Capital on Human Development Index in Turkey: An Empirical Analysis <i>Hale Kırer Silva L., Özlem Ayvaz Kızılgöl</i> | 516 |
| 45. | Geçiş Ekonomilerinde Makro Ekonomik Belirsizlik ve Yatırım İlişkisi | 528 |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | <i>Pelin Öge Güney</i> |
|-----|---|------------------------|
| 46. | Entrepreneurship Development and Poverty Incidence among Female Participants in Small Scale Enterprises in Lagos State, Nigeria <i>O Akande, Mutiat James, Abimbola Oladotun</i> | 536 |
| 47. | Ana Akım İktisadın Gelişmesinde Washington Uzlaşması'nın Rolü Üzerine Bir Değerlendirme <i>Selçuk Koç, Ayhan Orhan, Sema Yılmaz Genç, Erkan Oflaz</i> | 549 |
| 48. | Football Market Value and Economic Growth: Panel Data Analysis <i>Fatih Mangır</i> | 558 |
| 49. | Devletin Nihai Tüketim Harcamaları ve İşsizlik Arasındaki Nedensellik İlişkisi: Türkiye İçin Bir Analiz <i>Mehmet Bölükbaş</i> | 566 |
| 50. | Türkiye'de Dış Ticaret Açığının Sürdürülebilirliği Üzerine Bir Uygulama <i>Mehmet Dağ, Fatma Kızılkaya</i> | 578 |
| 51. | Türk Tarımında Ürün Arzı Yeterlilikleri ve Ekonomik Gelişmelere Etkileri <i>Mehmet Emin Erçakar</i> | 587 |
| 52. | The Challenges Faced by Occupational Psychologists in Selection and Assessment Processes <i>Meltem Yavuz, Rıfat Kamaşak</i> | 597 |
| 53. | Corporate Social Responsibility as a Source of Growth and Sustainability: A Thematic Analysis <i>Meltem Yavuz, Rıfat Kamaşak</i> | 607 |
| 54. | Yerel Yönetimlerde Halkla İlişkiler Projeleri: İzmir'in İlçe Belediyelerine Yönelik Bir Analiz <i>Mikail Batu, Şehriban Kayacan</i> | 616 |
| 55. | Yeni Medya Rahatsızlıkları: Yeni Nesil Medyaya Farklı Bir Bakış <i>Mikail Batu, Handan Güler-İplikçi</i> | 641 |
| 56. | Çevresel Maliyet Raporlamasının Rekabet Avantajı Üzerine Etkileri <i>Mustafa Arı, Gökhan Bayram</i> | 656 |
| 57. | Vadesinde Ödenemeyen Borçların Sermaye Olarak Gösterilerek Kredi Değerliliğinin Etkilenmesine Dönük Bir Uygulama <i>Muzaffer Şahin</i> | 674 |
| 58. | The View Point of the Food and Beverage Businesses in Istanbul Province on Green Supply Chain and Their Green Supply Practices with in the Context of Corporate Social Responsibility <i>Oğuz Diker, Oğuz Taşpınar</i> | 690 |
| 59. | Orta Gelir Tuzağı ve Beşeri Sermaye: Karşılaştırmalı Bir Panel Veri Analizi <i>Mustafa Özçağ, Mehmet Bölükbaş</i> | 700 |
| 60. | Finansal Oranların Önem Düzeylerinin Hesaplanmasında AHP ve BWM Yöntemlerinin Karşılaştırılması | 714 |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | <i>Ömer Faruk Rençber</i> | |
|-----|--|-----|
| 61. | Tüketici Güven Endeksi ile Seçilmiş Finansal ve Makroekonomik Göstergeler Arasındaki İlişki <i>İbrahim Murat Bicil, Çağatay Başarır, Özer Yılmaz</i> | 732 |
| 62. | Teknoloji İşletmelerinde Sıkı- Gevşek Örgüt Kültürü ve Kişi-Örgüt Uyumunun Çift Yönlülüğe Etkisi <i>Saadet Ela Pelenk</i> | 741 |
| 63. | İş Yeri Maneviyatı, Çalışmaya Tutkunluk ve İş Stresi Arasındaki İlişki: Sağlık Sektörü Çalışanları ile Bir Araştırma <i>Saadet Ela Pelenk</i> | 751 |
| 64. | The Effect of Personality and Self-Efficacy on Employee's Performance in Nigeria Higher Education <i>Abimbola Oladotun</i> | 761 |
| 65. | Enerji-Büyüme İlişkisi: Türkiye-Güney Kore Analizi <i>Sefer Uçak</i> | 769 |
| 66. | Politik İstikrar ve Büyüme İlişkisi: NIC Ülkeleri Örneği <i>Selim Demez, Fatma Kızılkaya, İdris Turan</i> | 783 |
| 67. | Dönüştürücü Liderlik ve İnovasyon Kültürü İlişkisi Üzerine Bir Araştırma <i>Semra Tetik, Bilgehan Emeklier, Nihal Emeklier</i> | 792 |
| 68. | Konaklama İşletmelerinin Değerlendirilmesi <i>Serkan Bertan, Serap Alkaya</i> | 804 |
| 69. | Tüketicilerin Rezervasyon Kararını Etkileyen Faktörler <i>Serkan Bertan, Serap Alkaya</i> | 812 |
| 70. | Factors Affecting Poverty: An Analysis for Nuts I Regions of Turkey <i>Aydanur Gacener Atış, Banu Has</i> | 819 |
| 71. | Türkiye' de KOBİ'ler ve İhracata Katkıları için Kobilere Yapılan Devlet Destekleri <i>Burak Çamurdan</i> | 831 |
| 72. | Doğrudan Yabancı Yatırımların Uluslararası Girişimciliğe Katkısı ve Önemi <i>Burak Çamurdan</i> | 852 |
| 73. | Türkiye'de 2001-2018 Yılları Arası Ödemeler Dengesi Hesap Açıkları ile Net Hata Noksan Hesabı İlişkisi Üzerine Genel Bir İnceleme <i>Burak Çamurdan</i> | 865 |
| 74. | Göç, Turizm ve Kayıtdışılık <i>M. Kenan Terzioğlu, Dilruba Can, İzlem Degigoğlu</i> | 877 |
| 75. | Göç ve Beşeri Sermaye: Doğu Avrupa Ülkeleri <i>M. Kenan Terzioğlu, Seçil Sert, Murat Aygün</i> | 889 |
| 76. | Bilgi Teknolojileri Kullanım Tatmini, Verimlilik ve Yenilikçilik İlişkisi <i>Meltem Akca</i> | 902 |
| 77. | Reel Döviz Kurunun Farklı Ülke Gruplarından Gelen Turist Sayıları Üzerindeki Etkisinin İncelenmesi: Türkiye Üzerine Bir Uygulama <i>M.Oğuzhan İlban, M.Tahsin Liceli, Sevgi Sezer</i> | 909 |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | |
|-----|---|------|
| 78. | İzmir İli Belediyeleri Tarafından Düzenlenen Festivallere Yönelik Bir İnceleme <i>Burcu Öksüz, Yeliz Yapıcıoğlu Ayaz</i> | 926 |
| 79. | Uluslararası Hizmetler Ticareti Rekabet Gücü Üzerine Bir Değerlendirme: Türkiye Örneği <i>Ahmet Aydın</i> | 939 |
| 80. | Alt-Örnekleme ve Üst-Örnekleme Yöntemleri ile Çalışanların İşten Ayrılma Tahmini <i>Ufuk Çelik</i> | 960 |
| 81. | Sinemada Yükselen Değer Marka Yerleştirme: Aile Arasında Filmi'nin Marka Yerleştirme Açısından İncelenmesi <i>Şükran Güzin Ilıcak Aydınalp, Sinem Tuna</i> | 966 |
| 82. | Klasik ve Modifiyeli Süper Etkinlik Modelleri ile Yenilenebilir Enerji Açısından Yılların Etkinliğinin Değerlendirilmesi <i>Serpil Gümüştekin Aydın</i> | 990 |
| 83. | "Kırılgan Sekizli" Arasında Finansal Komşuluk İlişkisinin Belirleyenleri <i>Sinem Atıcı Ustalar, Ramazan Ekinci, Hakan Kahyaoglu</i> | 997 |
| 84. | Yönetim Kurulunda Cinsiyet Çeşitliliği ve Sürdürülebilir Raporlama Kalitesi Arasındaki İlişki <i>Şerife Önder</i> | 1011 |
| 85. | Turizm Gelirleri ve Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişki: Granger Nedensellik Testi ile Araştırma <i>Savaş Erdoğan, Şeyma Torba</i> | 1024 |
| 86. | Sanat-Mekan İlişkisi: Müzelerin Sinemada Marka Olarak Kullanımı <i>Sinem Tuna</i> | 1031 |
| 87. | Devre Kesici Uygulamasının Piyasa Volatilitesi Üzerine Etkisi: Borsa İstanbul Uygulaması <i>Sibel Çelik, Yasemin Deniz Koç, Ferit Karahan</i> | 1049 |
| 88. | Güney Kore, Japonya ve Türkiye'de Enerji Politikasının Bir Unsuru Olarak Enerji Kaynaklarının Kullanımı <i>Sıtkı Selim Dolanay, Latif Onur Uğur, Bekir Sami Oğuztürk</i> | 1056 |
| 89. | Vadeli Piyasalarda Korunma Oranı ve Etkinliğinin Belirlenmesi: Borsa İstanbul Uygulaması <i>Sibel Çelik, Yasemin Deniz Koç, Ferit Karahan</i> | 1078 |
| 90. | İşe Alma Sürecinde Elde Edilen Skorlar ile Deneme Sürecindeki Çalışanların Performansı Arasındaki İlişkilerinin Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti Bankaları Üzerine Araştırma <i>Uğur Avcılar, Şükrü Umarbeyli</i> | 1086 |
| 91. | Örgütsel Adalet ile İlgili Yazılmış Tezlerin Bibliyometrik Analizi <i>Burcu Öksüz, Yeliz Yapıcıoğlu Ayaz</i> | 1108 |
| 92. | Çay Tüketiminde Motivasyonel Faktörlerin İncelenmesi: Nitel Bir Araştırma <i>Meltem Öztürk, Aybeniz Akdeniz Ar</i> | 1128 |
| 93. | Türkiye'de Finansal Gelişme ve Büyüme İlişkisi: Bootstrap Nedensellik Analizi <i>Selim Demez, Oktay Kızılkaya, Mehmet Dağ</i> | 1140 |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | |
|------|---|------|
| 94. | KKTC'de Elektronik Devlet Sistemi Yapılandırmasına Yönelik Vatandaşların Farkındalıklarının Değerlendirilmesi: Lefkoşa İlçesi Örneği <i>Ali Tatar, Fatma Taçoş</i> | 1150 |
| 95. | Enerji Tüketimi ve Ekonomik Büyüme İlişkisi: NIC Ülkeleri için Ampirik Bir Analiz <i>Fatma Kızılkaya, Mehmet Dağ</i> | 1168 |
| 96. | Aylak Tabanlı Süper Etkinlik Modeli İle Türkiye'deki İllerin Enerji Etkinliğinin Değerlendirilmesi <i>Serpil Gümüştekin Aydın</i> | 1178 |
| 97. | Veri Madenciliği İle Müşteri Kaybı Analizi <i>Ufuk Çelik</i> | 1188 |
| 98. | Değişime Hazır Olma: Havalimanı Çalışanlarına Yönelik Bir Alan Araştırması <i>Meltem Akca</i> | 1194 |
| 99. | Borsa İstanbul'da Sürü Davranışını Test Etmeye Yönelik Ampirik Bir Analiz <i>Ali Bayrakdaroğlu, Yusuf Tepeli</i> | 1201 |
| 100. | Yolsuzluk Dış Yardımlar için Önemli mi? Kantil Regresyon Analizi <i>Reyhan Cafrı, Pınar Özdemir Çukadar</i> | 1212 |
| 101. | Göç: Girişimcilik ve Bilgi Teknolojilerinin Etkisi <i>M. Kenan Terzioğlu, Mehmet Bulut, Eda Nur Erkut</i> | 1227 |
| 102. | US Monetary Policy, Global Risk Appetite and Capital Flows to Turkey <i>Osman Berke Duvan, Burçhan Sakarya</i> | 1241 |
| 103. | Osmanlı İmparatorluğu'nun Deniz Gücünün Ve Denizcilik Politikalarının Beş Önemli Savaş Üzerinden Analizi <i>Levent Bilgili</i> | 1255 |

**SOSYAL MEDYANIN TÜKETİCİLERİN SATIN ALMA NİYETİ ÜZERİNE ETKİSİ:
ÜNİVERSİTE ÖĞRENCİLERİ ÜZERİNE BİR MODEL ÖNERİSİ**

Ahmet UYAR*

ÖZET

Bu çalışmanın amacı; son yıllarda önem kazanan sosyal medyanın tüketicilerin satın alma niyetleri üzerindeki etkisini araştırmaktır. Günümüzde internet üzerinden yapılan ticaret oranı her geçen gün artmaktadır. E-ticaret alanında sosyal medya üzerinden yapılan pazarlamanın da etkisi azımsanmayacak boyutlardadır. Özellikle gençler sosyal medyayı sıkça kullanmakta ve alışverişlerini bu sanal ortamda gerçekleştirmektedir. Çalışmada sosyal medyanın gençlerin satın alma davranışları üzerindeki etkisi incelenmiştir. Bu amaçla öğrenciler üzerine bir anket uygulanmış, konuyla ilgili bir model oluşturulmuştur. Model yapısal eşitlikle test edilmiştir. Çalışma sonucunda öğrencilerin sosyal medya kullanımları, satın alma niyetleri üzerine etkisi, sosyal medyada ürün satın almaya karşı duyulan güven, sosyal medyanın pratik faydaları gibi konularda bakış açıları incelenerek algıları değerlendirilmiştir. Böylece e-ticaret yapan şirketlere pazarlamayla ilgili bazı önerilerde bulunulmuş, tutundurma, fiyatlandırma gibi konularda işletmelere öneriler yapılmıştır.

Anahtar Kelimeler: *Sosyal Medya, Satın Alma Niyeti, Tüketici Davranışları, Sosyal Medya Pazarlaması, Yapısal Eşitlik Modeli.*

JEL Kodları: *M30, M31, M39.*

**THE EFFECT OF SOCIAL MEDIA ON CONSUMER PURCHASE OF CONSUMERS: A
MODEL PROPOSAL ON UNIVERSITY STUDENTS**

ABSTRACT

The purpose of this study is to investigate the influence of social media, which has gained importance in recent years, on consumers' intention to buy. Today, the volume of trade carried out over the Internet steadily increases each day. In the field of e-commerce, marketing activities carried out over social media are also significant. Especially young people use social media frequently, and they shop in this virtual environment. The current study examined the influence of social media on the buying behaviours of young people. For this purpose, a questionnaire was administered to students, and a model was

* Afyon Kocatepe Üniversitesi, BUBYO, Afyonkarahisar, Türkiye, ahmetuyar@aku.edu.tr

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES**

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

established in this regard. The model was tested with structural equality. In the end, student perspectives on their use of social media, its influence on their intention to buy, the trust put on buying products in social media, practical benefits of social media, etc. were examined, and their perceptions were assessed. Based on this, some marketing suggestions including on promotion and pricing were made for companies carrying out e-commerce.

Key Words: *Social Media, Intention to Buy, Consumer Behavior, Social Media Marketing, Structural Equation Model,*

JEL Codes: *M30, M31, M39.*

1.GİRİŞ

Bilişim teknolojilerinde yaşanan değişimler son yıllarda inanılmaz boyutlara ulaşmıştır. Web 2.0 adı verilen teknolojik ilerlemelerde sosyal medya önemli bir yer teşkil etmektedir. Bunun nedeni sosyal medyayı geniş kitlelerin kullanıyor olmasıdır (Aydede, 2006: 34). We Are Social ve Hootsuite tarafından 238 ülkeden yapılan bir araştırmaya göre dünya üzerinde yaklaşık 3.8 milyar kişi internet kullanırken bunların yaklaşık 2.8 milyarı aktif olarak sosyal medya kullanmaktadır. Dünya üzerinde 1.61 milyar kişi e-ticaret kullanıcısıdır (Dijitalajanslar, 5.10.2018).

Nüfusunun önemli bir kısmı gençlerden oluşan ülkemizde de sosyal medya aktif olarak kullanılmaktadır. Türkiye’de mobil cihaz kullanıcısı sayısı 71 milyon iken bunların 48 milyonu aktif olarak sosyal medya kullanıcısıdır. Bu kişiler ortalama 7 saatlerini internet başında geçirirken bunun yaklaşık 3 saatini sosyal medya kullanımı oluşturmaktadır (Dijitalajanslar, 5.10.2018). Ülkemizde en fazla kullanılan sosyal medya aracı Youtube iken ikinci sırada Facebook bulunmaktadır (Igturkiye, 7.10.2018)

Sosyal medyanın iki yönlü bir iletişime imkân tanınması firmalar ile tüketiciler arasındaki iletişimi güçlendirmiştir. İşletmeler kendi sayfalarını açarak ve resim, video, yazı gibi araçları kullanarak müşterilerine daha yakın olmayı başarabilmektedir. Hızlı geri dönüş imkânı tanınması, geri bildirimlerin kolaylığı, müşteri hizmetleri ve reklam açısından firmalara önemli kolaylıklar sağlamaktadır. Ayrıca sosyal medya doğrudan pazarlama ve satış imkânı sağlamaktadır. Aracıların ortadan kalkması maliyetleri azaltmakta, ürünlerin daha uygun fiyata tüketiciye ulaşmasına neden olmaktadır. Tüketiciler açısından ise elde etmek istedikleri bilgiye kısa sürede ulaşabilmeleri, ürün ve firmalar hakkında daha önce yapılmış yorumları okuyabilmeleri, çok çeşitli ürünler hakkında karşılaştırma yapabilmeleri gibi nedenlerle sosyal medya önemli avantajlar sunmaktadır (Tutar, Ünalir ve Toker, 2015:194).

Sosyal medyanın tüketicilerin satın alma niyetleri üzerine etkisini inceleyen bu çalışma; giriş, literatür incelemesi, yöntem, bulgular ve sonuç bölümlerinden oluşmaktadır. Çalışmanın amacı öğrencilerin sosyal medya kullanımları ve bunun satın alma niyetleri üzerine etkisini inceleyerek sosyal medyada ürün satın almaya karşı duyulan güven, sosyal medyanın pratik faydaları gibi konulara değinmektedir. Bu temel amaç doğrultusunda bir model oluşturularak Yapısal Eşitlik aracılığıyla incelenmiştir. Çalışma sonunda sosyal medya kullanım alışkanlığının sosyal medyada satın almaya olan güveni nasıl etkilediği, satın almaya duyulan güvenin ise satın alma niyetine ve kullanılabilirliğe nasıl etki etkilediği konularına değinilmiştir. Böylece öğrencilerin sosyal medyadan ürün satın almalarına ilişkin bulgular paylaşarak bu alanda faaliyet yürüten işletmelere hedef kitlelerini daha iyi anlama ve daha doğru bir pazarlama yapma imkânı sağlayacak ipuçları verilmeye çalışılmıştır.

2. LİTERATÜR ÖZETİ

Sosyalleşmek her insan için önem arz eden bir konudur. Ancak internet teknolojilerinin gelişmesiyle birlikte sosyalleşmek farklı bir boyut kazanmıştır. Sosyal medya insanların kendi aralarındaki iletişimin gelişmesine yol açmış, sınırları kaldırmıştır. Sosyal medya; kullanıcıların paylaştığı verileri kendilerinin belirlediği, paylaştığı her türlü platforma verilen isimdir (Klieber, 2009: 8). Blossom'a göre (2009) sosyal medya; her bireyin diğerini etkilemesiyle ortaya çıkan, erişimin çok yüksek olduğu, iletişim teknolojileriyle gelişen ortak bir platformdur. Sosyal medya sayesinde insanlar internet teknolojisinde edilgen pozisyondan kurtulmuştur. Günümüzde bilgi, kullanıcılar sayesinde oluşturulmakta ve yayılmaktadır. Böylece bilginin özgürleşmesi ve gelişmesi kolaylaşmıştır (Bekaroğlu, 2011: 49).

Üzerinde kesin bir ortak tanımlama yapılamayan sosyal medyanın bazı özellikleri şöyledir; (Lerman, 2007: 16-28, Erdemir, 2017: 5)

Sosyal medya ölçülebilir, ulaşılabilir, yaygın bir mecradır. Sosyal medyada kullanıcı odaklı bir sistem bulunmaktadır.

Sosyal medya hem bireysel hem de kitlesel bir iletişim kurmak için idealdir. Bu platform sayesinde küresel ölçekte insanlar birbirleriyle iletişim kurabilmekte, tartışma, konuşma gerçekleştirebilmektedir.

Sosyal medya kamuoyu yaratma konusunda oldukça etkili bir mecradır. Burada çıkan haber ve düşünceler toplumu derinden etkileyebilmektedir.

Sosyal medyada insanlar kendileri gibi düşünen ve davranan kimselerle ortak bir alan oluştururlar.

Sosyal medya sayesinde kullanıcılar istedikleri içerikleri oluşturarak bunları değiştirebilirler.

Sosyal medya sayesinde tüketiciler kolaylıkla binlerce ürüne ulaşmakta ve işletmelerle bağlantıya geçebilmektedir. İnsanların pazara ulaşmasını kolaylaştıran bu mecra müşteri odaklı anlayışın gelişmesine yol açmıştır. Tüketicilerin kendi aralarında ürün ve hizmetler hakkında görüşmeleri kolaylaşmıştır (Mangold ve Faulds, 2009: 357).

Tüketicilerin sosyal medya üzerinden yaptıkları yorumlar firmaları olumlu ya da olumsuz etkilemektedir. Sosyal medya üzerinden yapılan yorumları birçok insan okumakta, yapılan paylaşımlar geniş bir kitleye ulaşmaktadır. Fikirler hızlı bir şekilde başka tüketicilere ulaşmakta, viral bir yayılım gerçekleşmektedir (Demirel, 2013: 73-74).

Evans'a (2008) göre sosyal medyayı kullanan tüketicilerin satın alma süreci şu şekilde gerçekleşmektedir: Öncelikle tüketiciler sosyal medyada ürünü görür, sonra bu ürün hakkında düşünmeye başlar, daha sonra ürün hakkında değerlendirme aşaması gerçekleşir. Bu değerlendirme aşamasında diğer kullanıcıların yorumları etkili olur. Daha sonra satın alma süreci yaşanır. Ürün alındıktan sonra onunla ilgili paylaşım ve geri bildirimler yapılır. Böylece bu süreç bir döngü şeklinde gerçekleşir. Sosyal medyada satın alma sürecine "sosyal geri besleme döngüsü" adı verilir.

Sosyal medyanın tüketici davranışlarını belirlediği günümüzde şirketlerin de hedef kitlesini oluşturduğu kişileri etkilemeleri ve onlara yönelik faaliyetler yapmaları giderek önem kazanmaktadır. Firmalar bu dönemde rekabet avantajı elde etmek için aktif bir veri tabanı kurmalı, bunu olabildiğince verimli yönetmeli, işletmenin internet üzerinden nasıl idare edilebileceği konusunda açık ve belirgin bir sisteme sahip olmalıdır. Ayrıca ulaşılabilir olma ve sorulara gecikmeden yanıt verebilmekte önemlidir (Kotler, 2000: 302). Firmaların sosyal medya stratejilerinde olması gereken özellikler şöyledir (Globalnet, 1.10.2018);

İşletmeler kendi ürün ve hizmetleriyle alakalı olarak internet üzerinde belirli periyodlarla analizler yapmalı olumlu ve olumsuz taraflarını belirlemelidir.

İşletmeler kendi internet siteleriyle sosyal medya hesaplarını bağlantılı olarak kullanmalı ancak birebir aynı stratejiyi uygulamamalıdır.

Sosyal medya hesapları sık sık güncellenmeli, aktif olmalı, şirket ve ürünler hakkında sürekli paylaşım yapılmalıdır.

İşletme kendisine ait olmayan ancak kendi hesabıymış gibi kullanılan diğer hesapları incelemeli, bunlar hakkında yasal takip başlatılmalı ve müşterilerini konu hakkında bilgilendirmelidir.

Sosyal medya profili ve paylaşımlar şirketin kurumsal kimliğine misyon ve vizyonuna uygun olmalıdır.

Hedef kitle iyi saptanmalı, ona uygun bir strateji belirlenmelidir.

Sosyal medyada pazarlama geleneksel pazarlamaya yeni ve tamamlayıcı bir boyut kazandırmıştır. İnternetin getirdiği farklılıklar bu güne kadar gerçekleştirilen pazarlamaya yeni bir perspektif kazandırmıştır. Bu değişimler yalnızca teknolojik ilerlemelerden değil onun getirdiği sosyal iletişimin ve dialog ortamının değişmesinden kaynaklanmaktadır (Sohn, 2005: 14). Sosyal medyada pazarlama geleneksel yöntemleri dışlayan bir anlayışı temsil etmemektedir. Çünkü yeni bir pazarlama biçimi de olsa geleneksel metotlardan beslenmektedir. Ancak farklı bir mecra olduğu için klasik pazarlama temelinde ortaya çıkan yeni bir yöntemi temsil etmektedir (Evans, 2008: 33).

3. YÖNTEM

3.1. Araştırmanın Amacı

Çalışmanın amacı; sosyal medyanın tüketicilerin satın alma niyeti üzerine nasıl bir etki yaptığını araştırmaktır. Bu amaçla üniversite öğrencilerine bir anket uygulanmıştır. Sosyal medyayı kullanım sıklığının sosyal medyada ürün satın almaya karşı duyulan güven üzerindeki etkisi, güven ve kullanılabilirlik faktörlerinin ise satın alma niyeti üzerindeki etkisi araştırmanın temel amaçlarını oluşturmaktadır. Böylece üniversite öğrencilerinin sosyal medyadan ürün satın alma niyetleri üzerindeki tutumları ölçülmeye çalışılmıştır.

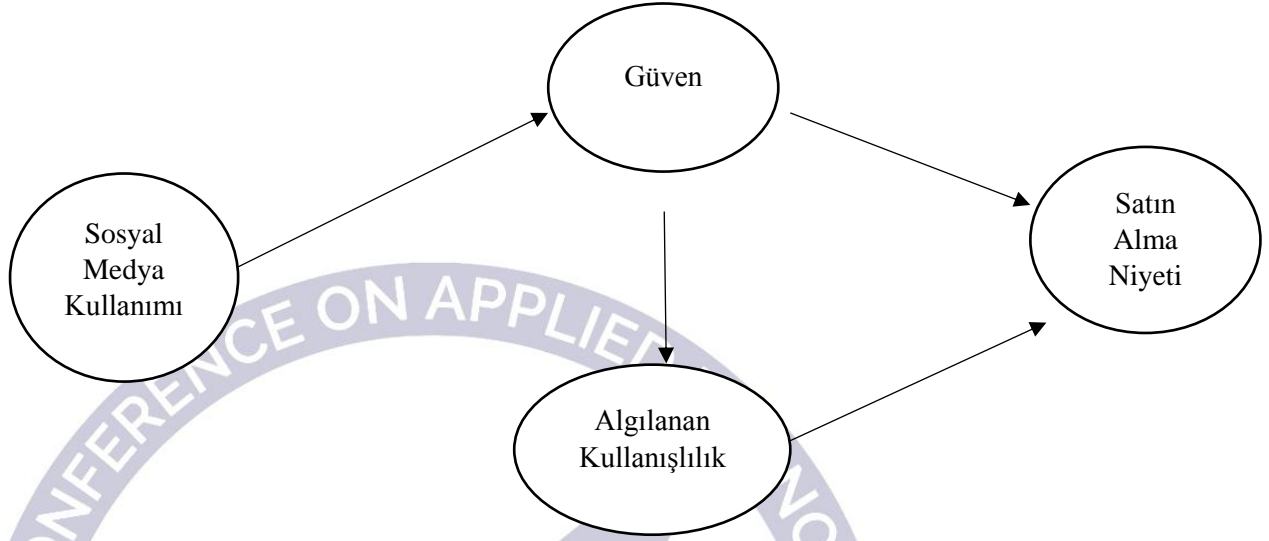
3.2. Örneklem ve Veri Toplama Aracı

Çalışmada anket yöntemiyle veriler toplanmıştır. Anket oluşturulurken literatürden faydalanılmıştır. Anket soruları ve model oluşturulurken Hajli'nin (2014) "A Study of The Impact of Social Media on Consumers" adlı çalışmasından yararlanılmıştır. Anket Afyon Kocatepe Üniversitesinde farklı fakültelerde okuyan 280 öğrenci üzerine uygulanmıştır. Veriler Kolayda Örneklem Metoduna göre toplanmıştır. Veriler yüz yüze anket yöntemiyle toplanmıştır.

Anket kendi içerisinde 2 bölümden oluşmaktadır. İlk bölümde katılımcıların demografik özelliklerine ilişkin ifadeler yer verilmiştir. İkinci bölümde ise sosyal medyadan satın alma niyetine ilişkin 12 soruya yer verilmiştir.

3.3. Araştırma Modeli ve Hipotezler

Çalışmada; sosyal medya kullanım alışkanlığı, sosyal medyadan alışverişe güven, sosyal medyanın kullanılabilirliği, satın alma niyeti gibi faktörlerin birbirleriyle arasındaki ilişkiyi gösteren bir model oluşturulmuştur. Şekil 1'e göre sosyal medya kullanımı güven faktörünü, güven faktörü, satın alma niyetini ve algılanan kullanılabilirliği, algılanan kullanılabilirlik ise satın alma niyetini etkilemektedir. Araştırma modeline uygun olarak çalışmanın hipotezleri aşağıda gösterilmektedir.



H1: Sosyal Medyada Kullanım Alışkanlığı Sosyal Medyaya Güveni Etkilemektedir

H2: Sosyal Medyaya Duyulan Güven Sosyal Medyanın Kullanışlılığını Etkilemektedir.

H3: Sosyal Medyanın Kullanışlılığı Sosyal Medyadan Ürün Satın Alma Niyetini Etkilemektedir.

H4: Sosyal Medyaya Duyulan Güven Sosyal Medyadan Ürün Satın Alma Niyetini Etkilemektedir.

4. BULGULAR

4.1. Açıklayıcı Faktör Analizi

Cronbach Alfa analizinde ankete katılan kişilerin verdikleri cevapların tutarlılığı ve soruları doğru cevaplayıp cevaplamadıkları gösterilir. Çalışmalarda Cronbach Alfa katsayısı güvenilirliği göstermektedir. Bu katsayı 1'e yaklaştığında çalışmanın daha güvenilir olduğu anlaşılmaktadır. Yapılan çalışmada bu katsayı 0,85'dir. Bu katsayıya göre anketin oldukça güvenilir olduğu anlaşılmaktadır. edilmektedir (Doğan, Şen, Yılmaz, 2015: 10).

Tablo 1'de katılımcıların sosyal medyaya karşı görüşlerine ilişkin faktör analizi sonuçları görülmektedir. Yapılan Faktör analizi neticesinde değişkenlerin toplam varyansın %72,510'unu açıklayan 4 faktörde toplandığı anlaşılmaktadır. Cronbach Alfa katsayısına göre her faktörün güvenilirliğini de yüksektir.

Tablo 1’de yer alan Kaiser-Meyer-Olkin (KMO) testi, örneklem büyüğünün yeterliliğini ölçmek için, Bartlett küresellik testi ise değişkenlerin tutarlılığının saptanmasında kullanılan testlerdir (Pett, Lackey ve Sullivan, 2003, s. 77). Yapılan çalışmada Kaiser-Meyer-Olkin değeri 0,848 olduğundan örneklem hacminin yeterliliğini Bartlett testi ise faktör analizinin kullanılabilir olduğunu göstermektedir ($\chi^2=1484,854$ ve $p<0.001$).

Tablo 1. Katılımcıların Sosyal Medyaya Karşı Görüşlerine Yönelik Faktör Analizi

| Faktörler / Maddeler | 1 | 2 | 3 | 4 | Cronbach's Alpha |
|---|------|------|------|----------|------------------|
| Faktör: Sosyal Medya Kullanımı | | | | | ,720 |
| Soru 1. Gün içerisinde sıklıkla sosyal medyayı kullanırım | ,659 | | | | |
| Soru 2. Birden fazla sosyal medya hesabına sahibim ve bunları aktif olarak kullanıyorum | ,619 | | | | |
| Soru 3. Sosyal medyaya birkaç gün bakmadığımda rahatsızlık hissediyorum | ,622 | | | | |
| Faktör: Sosyal Medyaya Güven | | | | | ,708 |
| Soru 4. Sosyal medya da alışveriş yaparken güvensizlik hissetmem | | ,571 | | | |
| Soru 5. Sosyal medya üzerinden ürün satın alırken kaygı duymam | | ,570 | | | |
| Soru 6. Sosyal medyada bilgilerimi paylaşırken rahatsızlık hissetmem | | ,655 | | | |
| faktör: Kullanışlılık | | | | | ,829 |
| Soru 7. Sosyal medyadan ürün almak fiyat avantajı sağlar | | | ,730 | | |
| Soru 8. Sosyal medyadan alışveriş yapmak zaman tasarrufu sağlar | | | ,683 | | |
| Soru 9. Sosyal medyadan ürün almak ürün karşılaştırmamı kolaylaştırır | | | ,752 | | |
| Faktör: Satın Alma Niyeti | | | | | ,898 |
| Soru 10. Önümüzdeki günlerde sosyal medya üzerinden alışveriş yapacağım | | | | ,761 | |
| Soru 11. Önümüzdeki günlerde sosyal medyadan farklı ürün ve hizmetler satın alacağım | | | | ,800 | |
| Soru 12. Sosyal medyadan daha çok alışveriş yapacağım | | | | ,777 | |
| Faktörlere İlişkin Aritmetik Ortalama Değerleri | 3,14 | 2,40 | 3,26 | 2,49 | |
| Faktörlere İlişkin Standart Sapma Değerleri | 1,14 | 1,02 | 1,19 | 1,21 | |
| Kaiser-Meyer-Olkin (Örneklem Yeterliliği) | | | | ,848 | |
| Bartlett Testi (Ki kare Değeri) | | | | 1484,854 | |
| Anlamlılık Düzeyi | | | | ,000 | |

4.2. Katılımcıların Demografik Özelliklerine İlişkin Tanımlayıcı Bilgiler

Ankete katılan 280 öğrencinin %51,1’i erkeklerden, %48,9’u kadınlardan oluşmaktadır. Ayrıca katılımcıların % 32’si 0-20 yaş aralığında % 68’i 21 ve üzeri yaş aralığında bulunmakta, % 43,9’u 0-1000 TL, %42,7 si 1001-2000 TL, 13,2’si 3000 TL ve üzeri gelire sahip olduğu anlaşılmaktadır.

4.3. Önerilen Modele İlişkin Yapısal Eşitlik Analizi Sonuçları

Yapısal Eşitlik Modeli (YEM) görünmeyen olguları sanki gerçek nesnelere gibi açıklamakta ve gözler önüne sermektedir. Gözlenemeyen değişkenler teorik olarak var olan ancak bazı verilerle anlaşılabilen ve ölçülebilen olgulardır (Şimşek, 2007: 8). YEM modelinde araştırmacı çalışmadan önce teorik olarak bir model oluşturur ve değişkenler arasındaki ilişkiyi ortaya koyar. Oluşturulan ölçüm modelinde gözlenen değişken ile gizil değişkenler arasındaki ilişki, faktör yükleri sayesinde gösterilir. Gözlenemeyen değişkenler birbirinden farklı gözlenebilen değişkenlerce ölçülür (Schumacker ve Lomax, 2004: 200).

Yapısal eşitlik modelinde geçerlilik ve güvenilirlik sağlamak için yapı güvenirliliği ve Cronbach Alpha $CR > 0.7$ den büyük olmalıdır (Fornell ve Larcker, 1981; Hair and vd. 1998).

LISREL yazılımıyla elde edilmiş YEM diyagramı şekil 2'de gösterilmektedir. Şekilde Sosyal Medya Kullanımı dışsal gizil değişkendir. Güven, Kullanışlılık ve Niyet gibi faktörler ise içsel gizil değişkenleri meydana getirmektedir.

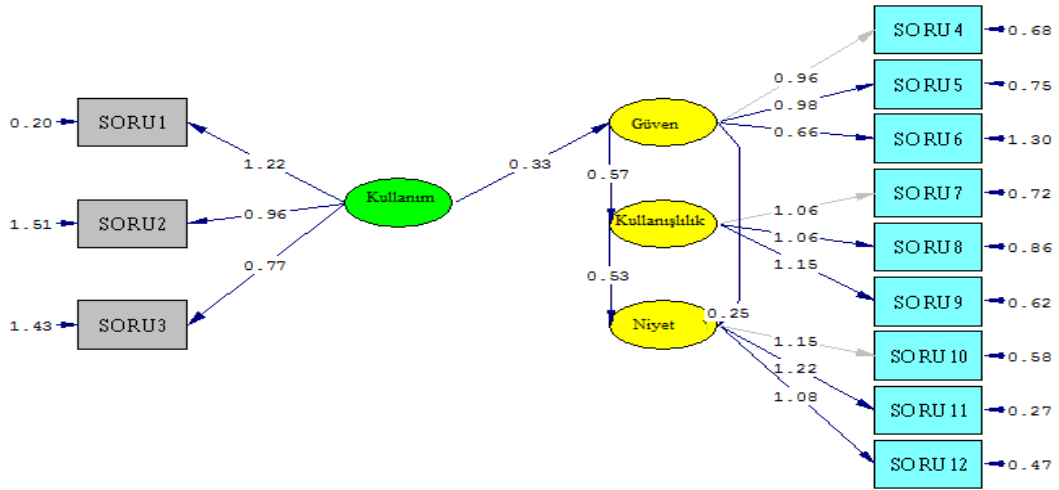
Dışsal değişkenle onu açıklayan gözlenen değişkenlerin korelasyon ilişkilerine bakıldığında soru 1'in sosyal medya kullanımı faktörünü daha iyi açıkladığı görülmektedir. Güven faktörünü 5. soru, kullanışlılık faktörünü 9. soru, niyet faktörünü ise 11. sorunun en iyi açıklayan maddeler olduğu görülmektedir. Anketteki tüm gözlenen değişkenlerin gizil değişkenlere ait faktörleri açıkladığı görülmektedir.

Path diyagramına göre dışsal gizil değişken olan sosyal medya kullanımı, sosyal medyaya güveni 0,33 oranında etkilemektedir. Bunun anlamı sosyal medyanın kullanımı 0,33 arttığında sosyal medyadan alışverişe olan güven 0,33 oranında artmaktadır.

Sosyal medyaya olan güven kullanışlılığı 0,57 oranında, kullanışlılık ise satın alma niyetini 0,53 oranında etkilemektedir. Bu değişkenler arasında pozitif yönlü orta şiddette bir ilişki bulunmaktadır.

Sosyal medyaya olan güven ise satın alma niyetini 0,25 oranında etkilemektedir. Sosyal medyaya güvende duyulan bir birimlik artış satın alma niyetini 0,25 oranında etkilemektedir. Bu iki değişken arasında pozitif yönlü düşük bir korelasyon ilişkisi bulunmaktadır.

Şekil 2. Modele İlişkin YEM grafiği



Chi-Square=80.67, df=50, P-value=0.00388, RMSEA=0.047

Çıkan sonuçlar birlikte değerlendirilerek tüm değişkenler göz önüne alındığında en güçlü ilişkinin sosyal medyaya güven ile kullanışlılık faktörleri arasında olduğu görülmektedir. Sosyal medyadan alışverişi güvenli olarak gören kişiler aynı zamanda sosyal medyadan alışverişi de daha kullanışlı ve yararlı görmektedir.

T değerleri göz önüne alındığında çalışmada ele alınan tüm hipotezlerin kabul edildiği anlaşılmaktadır.

Tablo 2. Araştırma Modeli İçin Yapısal Eşitlik Modeli Sonuçları

| Faktörler / Maddeler | Standart Yükler | t-değeri | R ² | Yapı Güvenirliliği | Açıklanan Varyans |
|---|-----------------|----------|----------------|--------------------|-------------------|
| Faktör: Sosyal Medya Kullanımı | | | | 0,73 | 0,49 |
| Soru 1. Gün içerisinde sıklıkla sosyal medyayı kullanırım | 1,22 | 13,74 | 0,88 | | |
| Soru 2. Birden fazla sosyal medya hesabına sahibim ve bunları aktif olarak kullanıyorum | 0,96 | 9,64 | 0,38 | | |
| Soru 3. Sosyal medyaya birkaç gün bakmadığımda rahatsızlık hissediyorum | 0,77 | 8,59 | 0,29 | | |
| Faktör: Sosyal Medyaya Güven | | | | 0,71 | 0,46 |
| Soru 4. Sosyal medya da alışveriş yaparken güvensizlik hissetmem | 0,96 | | 0,57 | | |

| | | | | | |
|--|------|-------|-------------|------|------|
| Soru 5. Sosyal medya üzerinden ürün satın alırken kaygı duymam | 0,98 | 9,49 | 0,56 | | |
| Soru 6. Sosyal medyada bilgilerimi paylaşırken rahatsızlık hissetmem | 0,66 | 7,18 | 0,25 | | |
| Faktör: Kullanışlılık | | | | 0,90 | 0,75 |
| Soru 7. Sosyal medyadan ürün almak fiyat avantajı sağlar | 1,06 | | 0,61 | | |
| Soru 8. Sosyal medyadan alışveriş yapmak zaman tasarrufu sağlar | 1,06 | 12,20 | 0,57 | | |
| Soru 9. Sosyal medyadan ürün almak ürün karşılaştırmamı kolaylaştırır | 1,15 | 13,13 | 0,68 | | |
| Faktör: Satın Alma Niyeti | | | | 0,90 | 0,75 |
| Soru 10. Önümüzdeki günlerde sosyal medya üzerinden alışveriş yapacağım | 1,15 | | 0,69 | | |
| Soru 11. Önümüzdeki günlerde sosyal medyadan farklı ürün ve hizmetler satın alacağım | 1,22 | 18,60 | 0,85 | | |
| Soru 12. Sosyal medyadan daha çok alışveriş yapacağım | 1,08 | 16,92 | 0,71 | | |
| Hipotezler | | | | | |
| H1: Kullanım&Güven | 0,33 | 4,41 | Desteklendi | | |
| H2:Güven&Kullanışlılık | 0,57 | 6,94 | Desteklendi | | |
| H3:Kullanışlılık&Niyet | 0,53 | 6,65 | Desteklendi | | |
| H4:Güven&Niyet | 0,25 | 3,27 | Desteklendi | | |

* p<0,05 anlamlılık düzeyinde

4 faktörden oluşan çalışmanın uyum ölçütleri Tablo 3'de gösterilmektedir. Araştırmanın uyumunu gösteren ki kare değeri (χ^2 / sd) olarak hesaplanır (Hair, vd., 1998; Jöreskog ve Sörbom, 1996; Schermelleh-Engel vd., 2003; Raykov ve Marcoulides, 2006).

Yapılan çalışmada ki kare: 1.61 bulunmuş ve çıkan sonucun iyi uyum değerleri arasında olduğu görülmüştür. Tabloya göre ortaya konan model ile standart değerler karşılaştırıldığında elde edilen sonuçların tümünün kabul edilebilir değerler arasında olduğu görülmektedir.

Tablo 3. Yapısal Eşitlik Modeline İlişkin Uyum Ölçütleri

| Uyum Ölçüsü | İyi Uyum | Kabul Edilebilir Uyum | Model Değeri | Uyum |
|-------------|------------------------|-----------------------------|--------------|-----------------------|
| χ^2/sd | $0 \leq \chi^2/sd < 2$ | $2 \leq \chi^2/sd < 3$ | 1,61 | İyi uyum |
| RMSEA | $0 \leq RMSEA < 0.05$ | $0.05 \leq RMSEA \leq 0.08$ | 0,047 | İyi uyum |
| SRMR | $0 \leq SRMR < 0.05$ | $0.05 \leq SRMR \leq 0.10$ | 0,080 | Kabul edilebilir uyum |

| | | | | |
|------|-------------------------|------------------------------|------|-----------------------|
| NFI | $0.95 < NFI \leq 1.00$ | $0.90 \leq NFI \leq 0.95^a$ | 0,97 | İyi uyum |
| NNFI | $0.97 < NNFI \leq 1.00$ | $0.95 \leq NNFI \leq 0.97^b$ | 0,98 | İyi uyum |
| CFI | $0.97 < CFI \leq 1.00$ | $0.95 \leq CFI \leq 0.97$ | 0,99 | İyi uyum |
| GFI | $0.95 < GFI \leq 1.00$ | $0.90 \leq GFI \leq 0.95$ | 0,95 | Kabul edilebilir uyum |
| AGFI | $0.90 < AGFI \leq 1.00$ | $0.85 \leq AGFI \leq 0.90$ | 0,93 | İyi uyum |

5. SONUÇ

Sosyal medya ülkemizdeki gençler arasında oldukça yaygın bir şekilde kullanılmaktadır. Sosyal medyanın gençler üzerindeki etkisi nedeniyle işletmeler bu mecraya daha önem vermeye başlamıştır. Yapılan çalışmada sosyal medyanın gençlerin satın alma davranışları üzerindeki etkisine ilişkin bir araştırma yapılmıştır. Bu amaçla bir model oluşturulmuştur. Model yapısal eşitlikle incelenmiştir.

Yapısal eşitlik modelinden elde edilen sonuçlara göre bağlamsal faktörlerden kullanım, güveni doğrudan etkilemektedir. Güven de kullanışlılığı direk olarak etkilemektedir. Sosyal medyayı aktif olarak kullanan katılımcılar sosyal medyadan ürün alırken kendilerini daha güvenli hissetmektedir. Bu kişiler aynı zamanda sosyal medyadan ürün almayı kullanışlı olarak görmektedir. Bağlamsal faktörlerden kullanışlılık niyeti etkilemektedir. Bunun anlamı sosyal medyanın kullanışlı olduğunu düşünen kişilerin önümüzdeki günlerde satın alma niyetleri daha fazladır. Bağlamsal faktörlerden güven de niyeti pozitif yönlü etkilemektedir. Yani sosyal medyaya güven duyan katılımcılar satın alma niyeti açısından da daha istekli görülmektedir.

Çalışmadan elde edilen veriler literatürde yer alan diğer çalışmaları desteklemektedir. Örneğin Hajli'nin (2014) yaptığı çalışmada da bu faktörlerin tamamının birbirini pozitif yönde etkilediği görülmüştür. Bu çalışmanın farkı üniversite öğrencileri üzerinde yapılmasıdır. Öğrencilerin üzerinde de aynı sonuçlara ulaşıldığı anlaşılmaktadır.

Üniversite öğrencilerinin sosyal medyada satın alma davranışlarını inceleyen bu çalışmadan elde edilen verilere göre; öğrencilerin önemli bir kısmı sosyal medyadan alışverişe olumlu yaklaşmaktadır. Ayrıca bu mecradan ürün satın alma konusunda istekli görülmektedir. Bazı kişilerde bulunabilen sosyal medyadan ürün satın alma konusunda yaşanan güvensizlik önemli ölçüde üniversite öğrencilerinde bulunmamaktadır.

İşletmeler açısından sosyal medyayı kullanan öğrenciler önemli bir hedef kitleyi oluşturmaktadır. Gençler yeniliklere açık olmaları ve sosyal medyayla daha küçük yaşlarda tanışmış olmalarından dolayı sosyal medya üzerinden yapılan pazarlama faaliyetlerine karşı daha olumlu yaklaşmaktadır. Bu nedenle

sosyal medyaya duydukları güven ve satın alma niyetleri daha yüksektir. Firmalar bu gerçeği görek üniversite öğrencilerine daha kolay bir şekilde ulaşma imkânına sahip olmakta, yaptıkları faaliyetler karşılığında daha pozitif geri dönüşler almaktadır. Fiyat, dağıtım ve tutundurma gibi faktörler sosyal medyanın gücü göz önüne alınarak yeniden değerlendirilmektedir. Reklamlarda hedef pazarı belirleme bu mecrayla birlikte daha kolay olmaktadır. Fiyat düzeyleri düşmekte, bu alanda rekabet artmaktadır. Dağıtım küresel ölçeğe yayılmakta ve giderek kolaylaşmaktadır. Hedef kitle olarak öğrencileri seçen işletmeler ürettikleri ürünlerde daha yenilikçi ve yaratıcı olmak durumunda kalmaktadır. Müşteri ilişkileri sosyal medyanın bir parçası haline gelmiştir. İşletmelerin tüm pazarlama bileşenlerine yaklaşımları ve iş yapma stratejileri büyük bir açıklıkla tüm toplum tarafından kolaylıkla gözlemlenebilmektedir. Gelecekte gençlerle daha iyi bir pazarlama iletişimi kuran firmalar bu mecrayı daha aktif kullananlar arasından çıkacaktır. Yeni kuşağın istek ve taleplerine ayak uyduramayan işletmeler ise önemli bir pazarlama fırsatı sunan sosyal medyada geri kalacak rekabet avantajını kaybedecektir.

KAYNAKÇA

- Bekaroğlu, Ş. B. (2011) “Doktor-Hasta İlişkilerinde Sosyal Medya Kullanımı”, Akademik Araştırmalar Dergisi, 13: 145-165.
- Blossom, J. (2009) “Content Nation-Surviving and Thriving as Social Media Changes on Customer Our Work, Our Lives and Our Future”, Indiana, Wiley Publishing Inc.
- Dijitalajanslar (2017), <http://www.dijitalajanslar.com/internet-ve-sosyal-medya-kullanici-istatistikleri-2017/> (5.10.2018).
- Erdemir, N. (2017) “Sosyal Medyanın Tüketici Davranışı Üzerindeki Etkisi”, Yüksek Lisans Tezi, İstanbul Ticaret Üniversitesi, Dış Ticaret Enstitüsü, İstanbul.
- Evans, D. (2008) “Social Media Marketing: An Hour a Day.” USA, SYBEX Inc. Alameda, CA.
- Fornel C., and Larcker D. F. (1981) “Evaluating Structural Equation Models With Unobservable Variables And Measurement Error”, Journal of Marketing Research, 18(1): 50.
- Globalnet (2018), <https://www.globalnet.com.tr/sosyal-medya-stratejisi-nasil-olmalı.html> (1.10.2018).
- Hair, F. J., Anderson, E.R., Tatham, L.R., ve Black, C.W. (1998) “Multivariate Data Analysis”, New Jersey, Prentice Hall.
- Hajli, N. (2014) “A Study of The Impact of Social Media on Consumers”, International Journal of Market Research, 56(3).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Joreskog, K. and Sörbom, D. (1996) "Lisrel 8: User's Reference Guide", Chicago, Scientific Software International.
- Kotler, P. (2000) "Kotler ve Pazarlama, Pazar Yaratmak, Pazar Kazanmak ve Pazara Egemen Olmak", İstanbul: Sistem Yayıncılık.
- Klieber, P. (2009) "Document Classification Through Data Mining Social Media Networks", <https://digital.archives.stetson.edu/digital/collection/Research/id/2097/>.
- Lerman, K. (2007) "Social Information Processing in News Aggregation", IEEE Internet Computing", 11(6), 16 - 28.
- Mangold G. W. and Faulds J. D. (2009) "Social Media: The New Hybrid Element of The Promotion Mix", Business Horizons, 52, 357-365.
- Igturkiye (2018), <https://www.igturkiye.com/guncel-internet-kullanimi-ve-sosyal-medya-istatistikleri-2018/> (7.10.2018).
- Raykov, T. and Marcoulides, G.A. (2006) "A First Course in Structural Equation Modeling", New Jersey, Lawrence Erlbaum Associates, Inc.
- Schermelleh-Engel, K. and Moosbrugger, H. (2003) "Evaluating The Fit of Structural Equation Models: Tests of Significance And Descriptive Goodness-of-Fit Measures", Methods of Psychological Research Online, 8(2): 23-74.
- Schumacher, E.R. and Lomax, G.R. (2004) "A Beginner's Guide to Structural Equation Modeling", New Jersey, Lawrence Erlbaum Associates.
- Şimşek, Ö.F. (2007) "Yapısal Eşitlik Modellemesine Giriş Temel İlkeler ve LISREL Uygulamaları", Ankara, Ekinoks.
- Sohn, D. (2005) "Interactive Media and Social Exchange of Market Information", Doctoral Thesis, The University of Texas at Austin in Partial Fulfillment of the Requirements for the Degree of Doctor of Philosophy.
- Tutar, K., Ünalır, M. O. ve Toker, L. (2015) "Sosyal Ağlar Üzerinde Ontoloji Tabanlı Sezgi Analizi İçin Bir Uygulama Çerçevesinin Geliştirilmesi", Pamukkale Üniversitesi Mühendislik Bilim Dergisi, 21(5).

KÜRESEL KRİZLERİN GELİŞMEKTE OLAN ÜLKELERDE YOKSULLUĞA ETKİSİ

Sumru BAKAN*

Onur AKKAYA**

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, sürdürülebilir büyümeye en çok ihtiyaç duyan gelişmekte olan ülkelerde son 30 yıl içinde yaşanan ekonomik krizlerin ortaya çıkış nedenleri ile ülkede yaşayan kişilerin bu krizler sonucu nasıl yoksullaştıklarının ve ardından yaşadıkları değişimin incelenmesidir. 1990'ların sonrasında finansal kaynaklı küresel anlamda kriz yaşamış ülkelerden sırasıyla Güney Kore (1997 – Güneydoğu Asya) ve (2000 ve 2001) Türkiye ekonomilerinin değişimi incelenmeye çalışılmıştır. İnceleme yapılırken ilk önce yaşanan krizin çıkışı ve seyri ele alınmış, sonra da bunun reel ekonomi üzerindeki etkisine değinilmiştir. Bu ülkelerin sahip oldukları sanayi yapısına bakıldığında, işgücünün büyük çoğunluğunun emek-yoğun üretimden olduğu görülmektedir. Çalışmada krizler sonrası ekonomilerin yaşadıkları değişim de ele alınmaya çalışılmıştır. Küresel kriz yaşamış ülkelerdeki gelir dağılımının uğradığı değişim Gini Katsayısı gibi birkaç indeks kullanılarak irdelenmiştir.

Anahtar Kelimeler: *Küresel Kriz, Gelişmekte Olan Ülke, Türkiye Ekonomisi, Güney Kore Ekonomisi, Yoksulluk*

JEL Kodları: *F44, F60, F63.*

ABSTRACT

The aim of this study is to examine how the economic crises experienced in developing countries, which need the most in sustainable development, and the people who live in the country have become poorer as a result of these crises.

Key Words: *Global Crisis, Developing Countries, Turkish Economy, Poverty*

JEL Code: *F44, F60, F63.*

* Doç. Dr., Kilis 7 Aralık Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, 7900, Kilis/Türkiye.
ORCID: 0000-0003-4686-6439.

** Dr., Kilis 7 Aralık Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, UTİL Bölümü, 7900, Kilis/Türkiye.
ORCID: 0000-0003-2694-9073

1.GİRİŞ

Küreselleşme ekonomik anlamda “mal, hizmet, sermaye, bilgi ve teknolojinin serbest dolaşımı yoluyla dünya ekonomisini bütünleştirme çabası” şeklinde tanımlanabilir. Bununla birlikte, küreselleşme günümüzde dünyanın başta ekonomik olmak üzere, siyasi, sosyal ve kültürel anlamda bütünleşmesi, tek kutuplu hale gelmesi yönüne doğru evrilmiştir. Ancak burada gerek çalışma konumuzla ilintili olması ve gerekse genel anlamda daha büyük önem taşıması nedeniyle, ekonomik boyutu üzerinde durulacaktır.

Bu bağlamda, ekonomik açıdan küreselleşmenin uluslararası ticaret, uluslararası üretim ve uluslararası mali akımlar olmak üzere, üç boyutu özellikle ön plana çıkmaktadır. Uluslararası ticari boyutu, ülkeler arasındaki mal ve hizmet akımları üzerindeki kısıtlamaların kaldırılması veya en aza indirilmesini” kapsar. Üretim boyutu, üretimin dünya üzerinde yaygınlaştırılarak, sınır ötesi hale getirilmesi olarak ifade edilebilir. Burada özellikle çokuluslu şirketler ön plana çıkmaktadır. Küreselleşmenin üçüncü ve günümüzde en çok ağırlık taşıyan yönü, mali ya da finansal küreselleşmedir. Finansal küreselleşme, döviz ve sermaye işlemleri üzerindeki engellerin kaldırılarak, ulusal piyasaların uluslararası finansal piyasalarla bütünleştirilmesidir (Seyidoğlu, 2003: 142).

Küreselleşmenin düşünsel temellerinin “Devletin ekonomiye en alt düzeyde müdahale etmesi gerektiği, ekonominin tam istihdam ve tam rekabet koşullarında dengeye geldiği” savı üzerine kurgulanan ve piyasa ekonomisini savunan Klasik İktisat ile atıldığını söylemek yanlış olmasa gerekir. Ancak, daha İkinci Dünya Savaşı sona ermeden, başta Avrupa ülkeleri olmak üzere ülke ekonomilerini yeniden canlandırma ve savaşın yıkıntılarından kurtarma, yeni bir uluslararası para sistemi oluşturma çabaları çerçevesinde 1944 yılında Bretton Woods Konferansları toplanmıştır. Bu konferansların en önemli sonucu Dünya Bankası (WB), Uluslararası Para Fonu (IMF), Birleşmiş Milletler (UN), daha sonra Dünya Ticaret Örgütü’ne (WTO) dönüşecek olan Tarifeler ve Ticaret Genel Anlaşması (GATT) vb, kuruluşların hayata geçirilmesi olmuştur. Dolayısıyla, bu çalışmalarla birlikte ülke ekonomilerini bütünleştirme çabalarının diğer bir ifadeyle, küreselleşmenin temellerinin de atılmış olduğu ifade edilebilir. Bununla birlikte; dünyada piyasa ekonomisine geçiş süreci ile ülke ekonomilerini bütünleştirme çalışmaları 1980’li yıllarla birlikte başlamıştır. Bu dönemde ülkemizde de ithalata dayalı sanayileşme stratejisinden ihracata dayalı sanayileşmeye geçildiği gibi, finansal piyasaların serbestleşmesi yönünde de bir dizi karar alınmıştır. Bu bağlamda, Türk Lirası konvertibl hale getirilerek, uluslararası sermaye hareketleri serbestleştirilmiştir. 1990 yılı sonrası ise bir yandan özellikle gelişmiş ülkelere doğru uluslararası sermaye akışkanlığı artarken, diğer yandan da Sovyetler Birliği’nin dağılması ile ortaya çıkan dönüşüm ekonomilerinin de piyasa ekonomisini benimsemeleri ve dünyanın tek kutuplu hale gelmesi küreselleşme sürecinin adımın konduğu ve

ekonomik anlamda hızlandığı yıllar olmuştur. Öte yandan, Avrupa Birliği'nin (AB) oluşumu ile yine AB ülkeleri içinde Euro Alanı oluşmasının da küreselleşmenin hızlanmasındaki payı yadsınamaz. Günümüz itibariyle Euro Alanı içerisinde Almanya, Avusturya, Belçika, Estonya, Finlandiya, Fransa, Hollanda, İrlanda, İspanya, İtalya, Güney Kıbrıs, Letonya, Litvanya, Lüksemburg, Malta, Portekiz, Slovakya, Slovenya ve Yunanistan yer almaktadır. Bununla birlikte, 1990'lı yıllarda kısa vadeli küresel sermaye hareketlerinin denetimsiz bir şekilde yüksek cari açığı bulunan ve bu açıklarını yüksek faizle kapatmaya çalışan az gelişmiş ve gelişmekte olan ülkelere yönelmesi, bu ülkelerin bankacılık sektöründeki ahlaki sorunlar ve spekülörlerin bu ülkelerdeki düşük kur yüksek faiz ortamından kazanç sağlama isteği nedeniyle döviz/bankacılık krizlerinin de sıklaşmasına yol açmıştır (Üzümcü vd., 2010:13). Söz konusu krizler 1990'lı yılların ortası ve 2000'li yılların başında ortaya çıkmıştır. Türkiye'nin de dahil olduğu gelişmekte olan ülkelerde yaşanan bu krizler; 1994 Meksika, 1997 Güneydoğu Asya, 1999 Brezilya, 2001 Arjantin Krizleri olarak sıralanabilir. Türkiye'de ise Kasım 2000 ve Şubat 2001 Krizleri bu anlamda önem taşımaktadır.

Meksika Krizi 1994 Aralık ayında patlak vermiştir. Meksika hükümetinin yüksek faizle ihraç ettiği iç borç senetlerine ve ülkenin uzun dönem borçlarını ödeyebileceği yönündeki işaretlere karşın, yabancı yatırımcıların enflasyonun ilerleyen dönemlerde de artacağına dair beklentilerinin kırılamaması ve ülkenin borçlarını geri ödeyemeyeceğine dair oluşan bir inancı, ülkeye yaptıkları yatırımları durdurmalarına neden olmuştur. Meksika hükümetinin 20 Aralık 1994 tarihinde döviz kuru bandını % 15 oranında genişletme kararının ardından, ülke parası Pezo beklenenden çok daha hızlı bir şekilde değer kaybetmeye başlamış ve uluslararası rezervler iki gün içinde 5 milyar dolar erişmiştir. Ancak, bunun da yeterli olmayacağı düşüncesi ile ülke parası 22 Aralık tarihinde dalgalanmaya bırakılmış ve bunun etkisiyle faiz oranları aşırı yükselerek bankacılık sektörünün portföy yapısı bozulmuştur. Bu durumun etkisiyle uluslar arası yatırımcılar fonlarını hızla geri çekerek krize yol açmışlardır. Meksika'daki krizin bölgede oluşturduğu güvensizlik "tekila" etkisiyle diğer Latin Amerika ülkelerine de sıçramış ve bölge ülkelerinin borsalarında önemli düşüslere neden olmuştur. Krizle birlikte Meksika'ya yönelik portföy yatırımları azalmış ve 1995 yılında Meksika ekonomisinden yaklaşık 3,4 milyar dolarlık portföy yatırımı çıkmıştır (Eren, 2010: 40-41).

1997 Güneydoğu Asya krizi, ekonomide yaşanan bir takım makroekonomik bozukluklar ve yanlış uygulanan bazı politikalar nedeniyle meydana gelmiştir. Endonezya, Malezya, Filipinler, Singapur ve Tayland'da ortaya çıkan krizi hazırlayan nedenler arasında söz konusu kriz öncesinde Asya ülkelerine yurt dışından büyük miktarda yabancı sermaye girişi gösterilmektedir. Yüksek büyüme oranları, düşük enflasyon, bütçe performansının yüksekliği, sabit döviz kuru uygulaması ve hükümet tarafından yabancı sermayeyi çekmek için verilen teşvikler ve nispeten yüksek faiz oranları bu ülkelere yabancı sermayenin

gelişini cazip kılan nedenler olarak sıralanmaktadır. Sermaye girişleri kredilerin hızlı bir şekilde artmasını sağlayarak finansal varlık fiyatlarını büyük miktarda yükseltip, aşırı risk alınmasına sebep olmuştur. Krize bağlı olarak gayrimenkul sektöründe hızlı düşüş ve çöküşler ve finans sektöründe iflaslar yaşanmış, borsa büyük düşüşlere sahne olmuş, kredilerin hacmi azalmış, iş güvencesi gerçek anlamda tehlikeye girmiş, hane halkı harcamaları azalmıştır. Kısacası, beş yıllık bir durgunluk yaşanmıştır. Dolayısıyla, Asya krizinin en belirgin etkisi olarak bu ülkelerde yaşanan ekonomik daralma ve buna bağlı olarak ekonomik büyümenin yavaşlaması gösterilmektedir (Engin, 2007: 42-43).

Türkiye ekonomisi ise yaşadığı 1994 krizinin ardından, 1990'ların sonuna kadar ciddi bir ekonomik kriz yaşamamıştır. Bununla birlikte, 1999 yılına gelindiğinde büyük bir problem olan yüksek enflasyon, sermaye hareketlerindeki istikrarsızlık, bankacılık sistemindeki sorunlar, devlet borçlanma gereksinimlerinin artması ile ekonomi çıkmaza girmiş, Kasım 2000 ve Şubat 2001'de birbiri peşi sıra iki büyük kriz yaşamıştır (Çiğdem, 2016: 68). 5 Nisan 1994 Kararları sonrası uygulanan istikrar programı kısa dönemde olumlu sonuç vermiş olmakla birlikte, orta dönemde başarı sağlayamamıştır. Kısa dönemde ihracat artışı sağlanmış, cari işlemler bilançosu düzelmiş, Kamu Kesimi Borçlanma Gereğinin GSMH'ya oranı düşmüş olmakla birlikte, 1995 yılı sonlarında cari işlem açıkları yine yükselmeye başlamıştır. 1996 yılından itibaren yüksek enflasyona bağlı olarak paranın reel değerindeki düşüş ekonomide ciddi dolarizasyon etkisi yaratmıştır. Diğer yandan, 1997 yılında Güneydoğu Asya'da ve 1998'de Rusya'da yaşanan krizler de ülke ekonomisini olumsuz yönde etkilemiştir. Günümüzdeki adıyla İstanbul Borsası, o zamanki adıyla İstanbul Menkul Kıymetler Borsası'nda (İMKB) hisse senetlerinin değeri hızla düşmüş, ülkeden sermaye çıkışları olmuş ve döviz rezervleri azalmıştır. 1998 Rusya krizinin etkisi ve bütçe açıkları ile iç ve dış borçlardaki aşırı artış nedeniyle IMF ile "yakından izleme" anlaşması yapılmıştır. 1999 yılında gerçekleşen 17 Ağustos depreminin ardından büyüme rakamları yeniden negatife dönmüş, %-7.3 olarak gerçekleşerek, bir önceki yıla göre %5 azalmış ve enflasyon %53.2 düzeyine ulaşmıştır. Görüldüğü üzere, ülkenin makroekonomik göstergelerinde ciddi sapmaların söz konusu olduğu bu durum karşısında, 1999'da Uluslar arası Para Fonu (IMF) ile "stand-by" anlaşması imzalanmıştır. Buna bağlı olarak, enflasyonla mücadele programı yürürlüğe konarak, enflasyonun temel nedeni olan kamu açıklarının giderilmesi hedeflenmiştir. IMF ile yapılan anlaşma sonucunda 2000 yılında uygulamaya konulan istikrar programının ana hatlarını maliye reformu, nominal döviz kuru çıpasına dayalı para politikası, özelleştirmeler, faiz dışı fazlanın arttırılması, vergi, sosyal güvenlik ve tarım alanlarında reformlar yapılmasını öngören yapısal dönüşüm programı oluşturmuştur (Danışoğlu, 2007: 7-8).

2000 yılında kur çıpası uygulaması sonucunda daha düşük faiz oranlarıyla dış borçlanma yapılmış, enflasyonist beklentiler azalmış ve faiz dışı fazlanın GSMH içindeki payı artmıştır. Tüm bu

gelişmelerin etkisi ile faiz oranları düşüş kaydetmiş olmakla birlikte, bu durum tüketici kredilerinin beklenen üzerinde artmasına yol açmıştır. Enflasyonun beklenenin üzerinde gerçekleşmesi TL'nin aşırı değerlenmesi sonucunu yaratarak, ithalatta ciddi bir artışa neden olmuştur. Cari işlemler açığında meydana gelen artışın sermaye girişleri ile karşılanamaması ülkede devalüasyon beklentisini arttırmıştır. Açık pozisyon sorunu ile karşı karşıya kalan bankaların da bu açıklarını kapatma endişeleri piyasada likidite sıkışıklığı yaşanması sonucunu doğurmuştur. Bir yandan, döviz talebindeki artışın faiz artışı ile dengelenmeye çalışılması, diğer yandan da, Tasarruf Mevduatı Sigorta Fonu'nun (TMSF) o zaman faaliyet gösteren Demirbank'a el koyması faiz oranlarını aşırı yükseltmiştir. Bankalar arası Para Piyasası gecelik borçlanma faizleri de artarak T.C. Merkez Bankası döviz rezervleri önemli ölçüde azalmıştır. Kasım 2000 Krizi sonrası IMF'den temin edilen "ek rezerv kolaylığı" biçimindeki kredi, piyasada TL'den dövizde kayılmasını önlemek anlamında yarar sağlamış olsa da kısa vadeli ve yüksek maliyetli olmuştur. Kur çıpası savunulmuş olmakla beraber uygulanan istikrar programının güvenilirliği sarsılmış, krize açık yapı sürdüğünden dolayı 2001 Şubat ayındaki siyasi kriz hemen bir döviz krizine dönüşmüştür. Böylece, Türkiye ekonomisi 2001 yılında küçülmesinin ardında 2002 yılından itibaren önemli bir dönüşüm ve gelişim sürecine girmiştir". 2001 krizini takiben hükümet "güçlü ekonomiye geçiş" adı altında yeni bir program ortaya koymuştur (Danışoğlu, 2007: 8). 2001 yılı istikrar programının temel hedefleri; sürdürülemez boyutlara ulaşan kamu kesimi iç borç dinamiğinin ortadan kaldırılması, ekonominin dış desteğe muhtaç olmayacak biçimde sağlıklı bir yapıya kavuşturulması ve bu amaca uygun olarak, finansal piyasaların yeniden yapılandırılarak, bankacılık kesimine işlerlik kazandırılması olarak belirlenmiştir (Ural, 2003: 18). Ekonomik program çerçevesinde alınan tedbirler ile mali disiplin sağlanarak, faiz oranları düşürülmüş ve enflasyon tek haneli rakamlara indirilmiştir. Programın en önemli ayaklarından birini oluşturan bankacılık kesimi sağlıklı bir yapıya kavuşturularak, sermaye ve risk yapısı açısından güçlendirildiği gibi, Merkez Bankası kurumsal olarak bağımsız bir yapıya kavuşturulmuştur (Danışoğlu, 2007: 8).

1990'lı yıllarla birlikte küreselleşmenin hız kazanması sonucu gerek diğer gelişmekte olan ülkeler, gerekse ülkemiz, sağlam bir makroekonomik yapıya sahip olmaması nedeniyle dışsal şoklardan fazlasıyla etkilenir ve başta döviz/finansal krizler olmak üzere ekonomik krizlere duyarlı hale gelmiştir.

Bu çalışmanın ikinci bölümünde ele alınan krizlerle ilgili literatür taramasına değinilmiştir. Üçüncü bölüm kullanılan veri seti ve metodolojiyi içermektedir. Dördüncü bölümde ise ele alınan ülkeler bağlamında krizler sonrası dönemde yaşanan değişim grafikler yardımıyla ele alınmıştır. Çalışmanın, beşinci bölümünde ise kullanılan veriler ışığında sonuç kısmı yer almaktadır.

2.LİTERATÜR TARAMASI

Danişoğlu (2007), tarafından yapılan çalışmada küreselleşmenin gelişmiş ülkelerin hem kaynak hem de hedef ülke olarak mal ve sermaye akımlarından ve global gelirden daha fazla pay almalarını sağladığı, bununla birlikte, gelişmekte olan ülkeler için durumun aynı olmadığı ve söz konusu ülkelerin Neo-Liberal politikaların savının aksine, yoksulluk ve gelir eşitsizliğini arttırdığı şeklinde bir değerlendirme yapılmıştır.

Yanar ve Şahbaz (2013), yaptıkları çalışmada 102 gelişmekte olan ülkenin 2010 yılı verilerini kullanarak söz konusu ülkelerde küreselleşme, yoksulluk ve gelir eşitsizliği arasındaki ilişkiyi test etmişlerdir. Araştırmacılar gelişmekte olan ülkelerde ekonomik, politik ve sosyal küreselleşmenin hem yoksulluğu hem de gelir eşitsizliğini azalttığı bulgusuna ulaşmışlardır.

Memiş (2014) tarafından yapılan ve ikincil kaynaklardan elde edilen verilerin derlenip yorumlandığı çalışmada yoksulluğun küresel bir sorun olduğuna vurgu yapılarak, özellikle az gelişmiş ülkelerin küreselleşmeye bağlı olarak daha fazla yoksullaştığı belirtilmiştir

Yiğit (2015) tarafından yapılan çalışmada, Türkiye ve Orta Asya Türk Cumhuriyetleri'nin yoksulluk ve diğer ekonomik göstergeler açısından durumu incelenmiştir. Buna göre, Türkiye'de kriz sonrası yoksulluk verilerinin, 2003'den itibaren yoksullukla mücadele sürecinde kaydedilen ilerlemenin küresel krizin etkisiyle kesintiye uğramadığı, ülkede günlük geliri 1 Doların altında olan nüfus bulunmadığı ve ulusal yoksulluk sınırı altında kalanların oranında artış olmadığı görülmüştür. Orta Asya Türk Cumhuriyetleri'nde ise küresel krizin yoksullukla mücadele sürecini olumsuz etkileyip etkilemediğinin, araştırmanın yapıldığı dönemde yeterli sayısal verinin henüz olmadığı gerekçesi ile değerlendirilemediği ifade edilmiştir.

Dama (2017) tarafından yapılan çalışmada, Türkiye'nin 2008 ve 2009 yıllarındaki küresel krizin olumsuz etkisi haricinde yoksulluğun 2002-2016 arası dönemde başarılı bir grafik çizerek, sürekli bir azalış trendi içerisinde olduğu tespit edilmiş ve bunda Gayri Safi Yurtiçi Hasıla (GSYH) miktarının yükselmesi ile sosyal koruma harcamalarındaki artışın etkili olduğu dile getirilmiştir

3.METHODOLOJİ VE VERİ SETİ

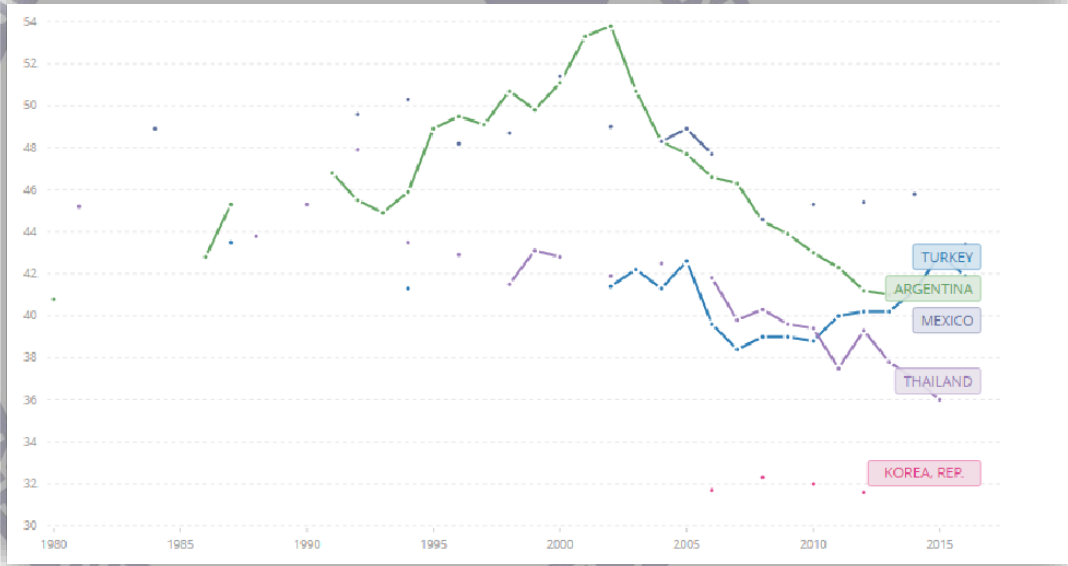
Çalışmanın veri seti Dünya Bankası 2000-2017 dönemini kapsayan veri setinden elde edilmiştir. Yaşanılan değişimi görebilmek için Gini Katsayısı, Günlük 1,90 \$, 3,20 \$, 5,50 \$ altında gelir dağılımı, Ulusal yoksulluk sınırlarında yoksul nüfus sayımı oranı (nüfusun% si) ve Ulusal yoksulluk sınırlarında kırsal yoksulluk sayısının oranı (kırsal nüfusun% 'si) değişkenleri kullanılmıştır.

Gelir eşitsizliğini ölçmede yaygın olarak kullanılan Gini katsayısı, Lorenz eğrisinden hesaplanmaktadır. Gini katsayısı, Lorenz eğrisinde 45 derecelik mutlak eşitlik doğrusu ile Lorenz eğrisi arasında kalan alanın, mutlak eşitlik doğrusunun altında kalan üçgenin alanına oranıdır (Hyman, 1983: 432). Gini katsayısının değeri 0 ile 1 arasında değişir. Katsayının yükselmesi gelir eşitsizliğinin artması, düşmesi ise azalması anlamına gelmektedir.

4. ANALİZ SONUÇLAR

Çalışmanın bu bölümünde ele alınacak indeks değerleri dikkate alınarak 1990'larda krizlere maruz kalmış ülkelerin genel durumlarına değinilecektir.

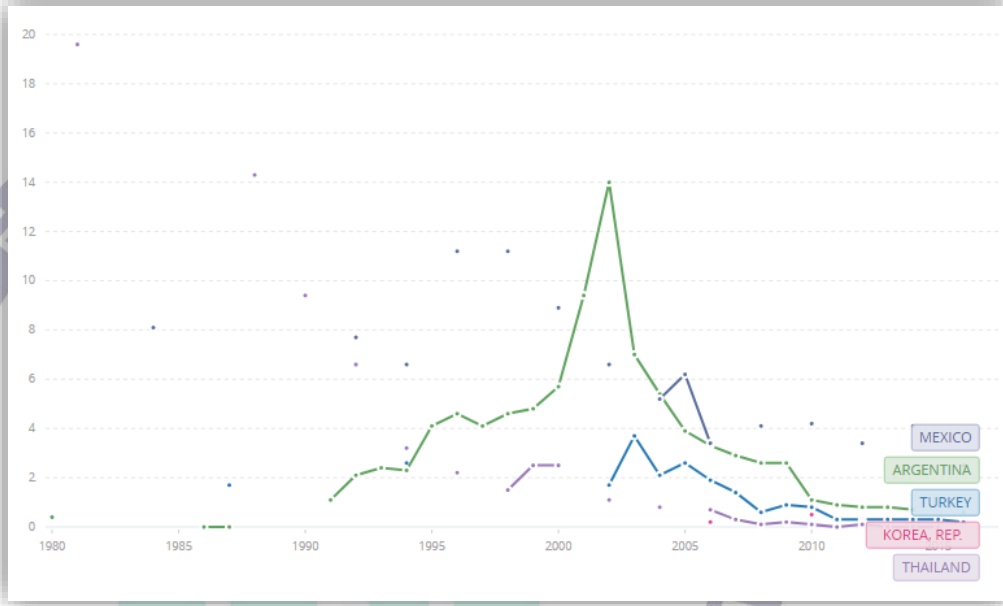
Grafik 1. 1990-2015 Dönemi Gini Katsayısı



[Grafik 1]'e göre Arjantin'in 1995 ile 2000 yılları arasında Gini katsayısının 0.42-0.55 arasında yer aldığını ve artış eğilimine sahip olduğunu görmekteyiz. 2000'lerin başından 2015'lere kadar katsayının azaldığı görülmektedir. Ancak bu geri dönüş 0.40 civarında son bulmuştur. 2000 ve 2001 yıllarında yapısal değişime sebep olan krizlerin yaşandığı Türkiye ekonomisine bakıldığında, 2000 ile 2010 dönemi için Gini katsayısının 0.42 civarından 0.38'lere kadar gerileği gözlenmektedir. Özellikle 2010 sonrası dönemde yükseliş eğilimine dönen katsayı tekrardan 0.44 düzeylerine geri dönmüştür. G. Kore'ye ilişkin elde edilen verilerin yetersizliği nedeniyle çok sağlıklı bir değerlendirme yapılamamakla birlikte, Gini katsayısı değerinin 2005 sonrası dönemde 0.32 dolaylarında seyrettiği görülmektedir. Tayland'ın katsayı değişiminin 2000'lerden sonra 0.42'lerden 0.36'lara doğru yön değiştirdiğini ve iyileşme gösterdiğini söyleyebiliriz. Genel olarak ülkeleri karşılaştırdığımızda, 2000'ler sonrası

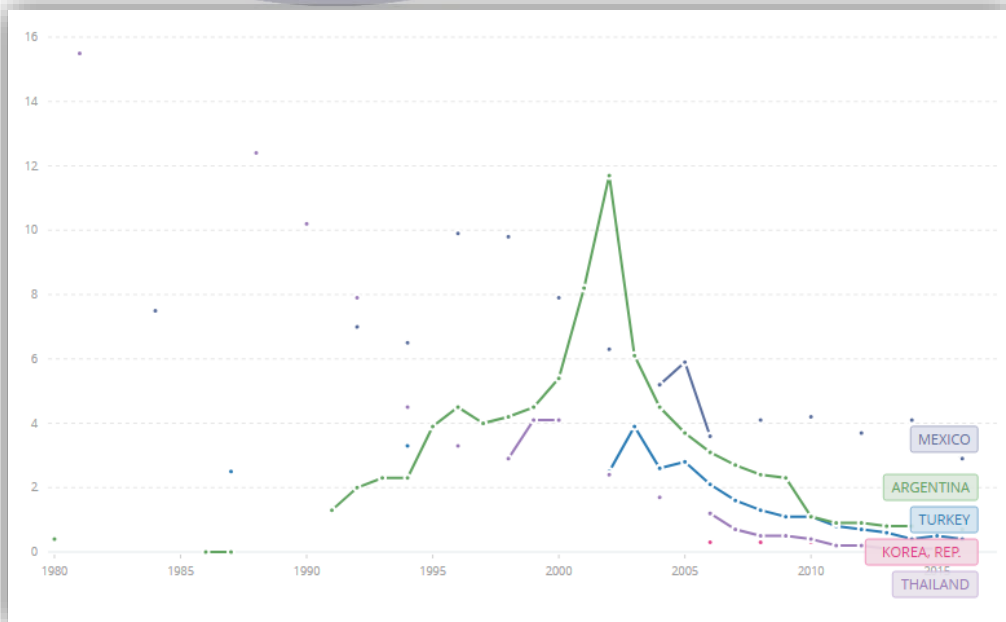
dönemde G. Kore'nin en düşük Gini Katsayısına sahip olması nedeniyle, en az gelir dağılımı eşitsizliğine sahip ülkeler olarak nitelendirilir. Arjantin ise Gini katsayısının en yüksek seyrettiği ülkeler olarak en fazla gelir eşitsizliğine sahip ülkeler olarak sıralamada yer almıştır.

Grafik 2. Günlük 1.90\$ Gelire Sahip Olan Nüfusun Ülke Nüfusuna Oranı (2011 Satın Alma Gücüne Göre)



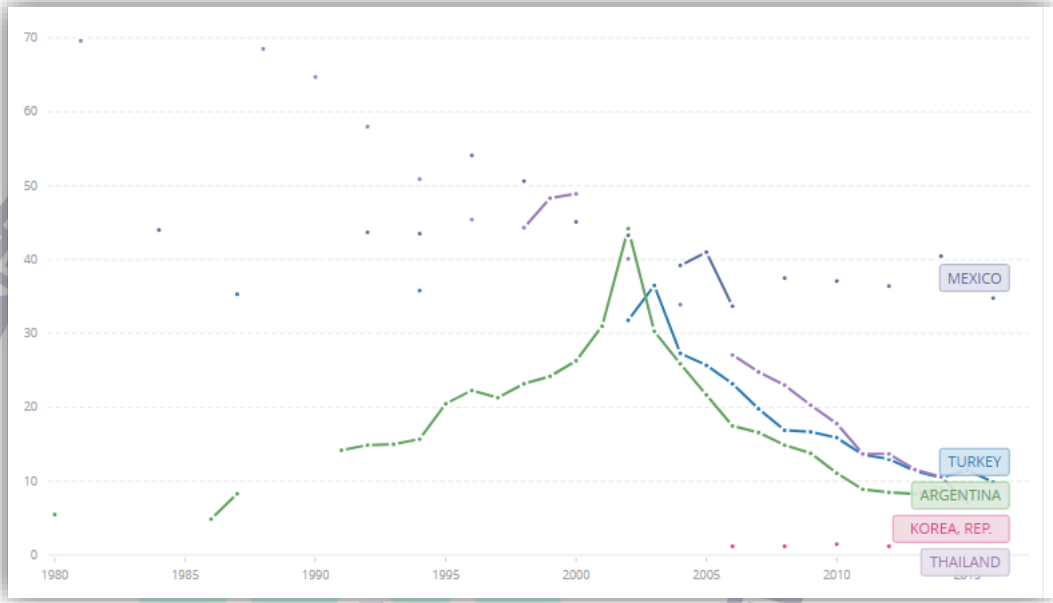
[Grafik 2]'de yer alan günlük geliri 1.90\$'ın altında kalan ülkelere bakıldığında; G. Kore ve Tayland'ın Gini Katsayısında sahip olduğu düşük seviyeleri destekler şekilde toplam geliri 1.90\$'ın altında en düşük nüfusa sahip ülke görünümünde olması ile dikkat çekmektedir.

Grafik 3. Günlük 3.20\$ Gelire Sahip Olan Nüfusun Ülke Nüfusuna Oranı (2011 Satın Alma Gücüne Göre)



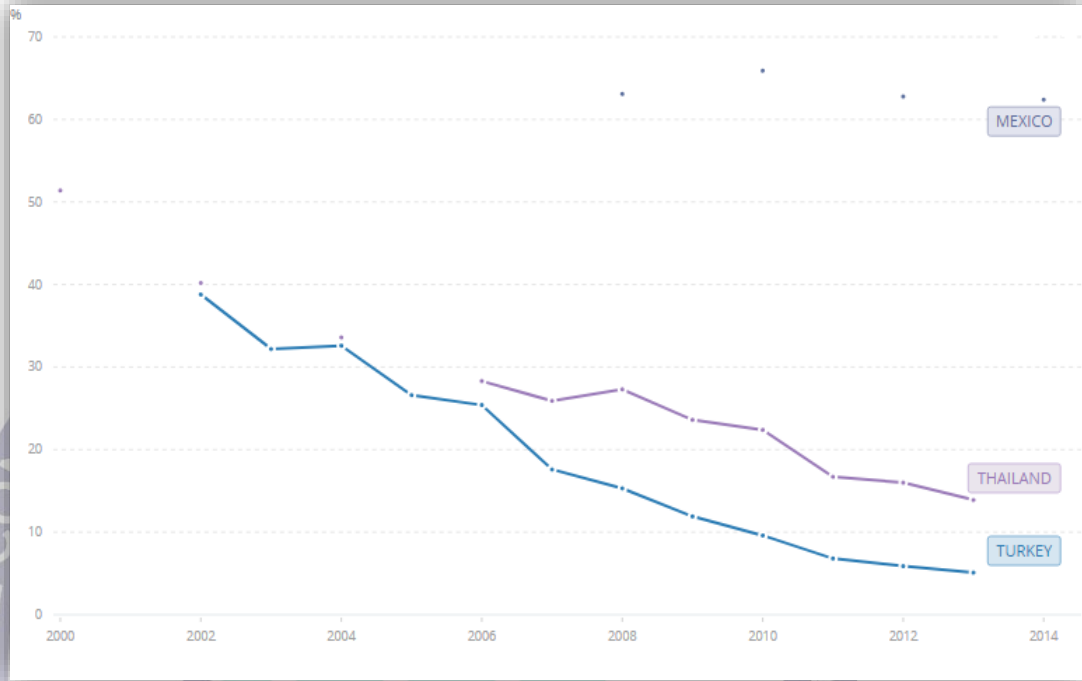
Diğer yandan, [Grafik 3]'de gösterilen günlük kazancı 3.20\$'ın altında kalan ülkelerin sıralaması [Grafik 2]'deki sıralamayı destekler niteliktedir.

Grafik 4. Günlük 5.50\$ Gelire Sahip Olan Nüfusun Ülke Nüfusuna Oranı (2011 Satın Alma Gücüne Göre)



[Grafik 4] ise günlük geliri 5.50\$'ın altında kalan nüfusun toplam nüfusa oranını göstermektedir. Buna göre, Arjantin, Türkiye ve Tayland'ın sıralamasının değiştiği görülmektedir. Grafikteki verileri baz aldığımızda, Arjantin için yıllar içindeki değişimin önceki verilere göre (Grafik 2 ve 3), daha yumuşak bir geçiş şeklinde olduğu görülmektedir. Meksika için ise elde edilen bulgular ışığında, “günlük geliri 5.50\$'ın altında kalan nüfusun toplam nüfus içindeki payının en fazla olduğu ülkedir” diyebiliriz.

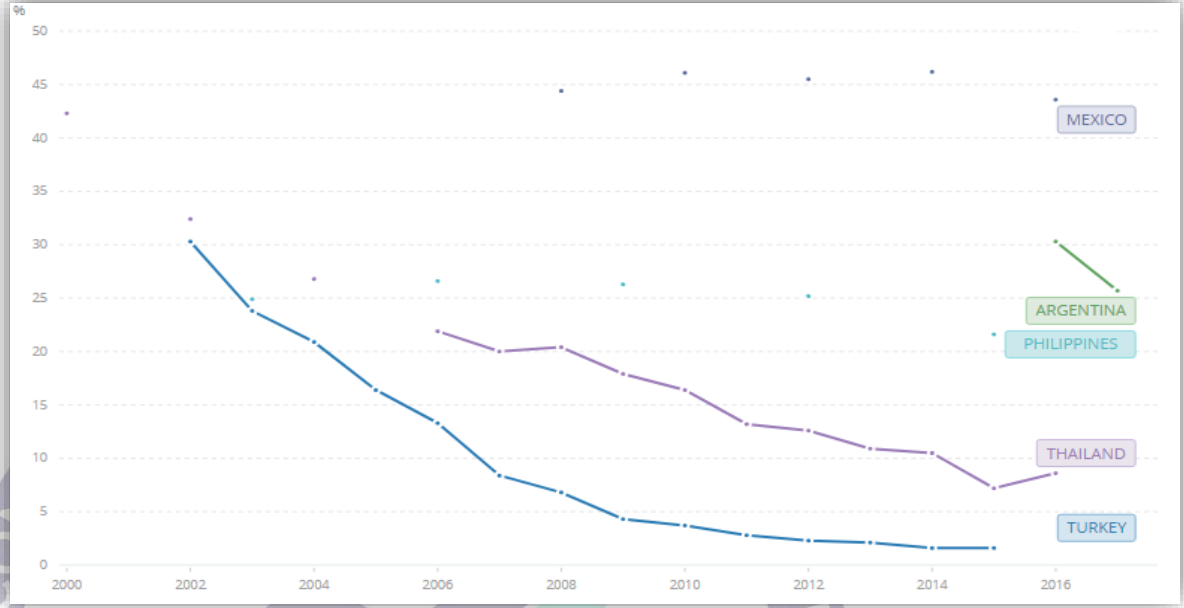
Grafik 5. Ulusal Yoksulluk Sınırlarında Kırsal Yoksulluk Sayısının Oranı (Kırsal Nüfusun% 'si)



[Grafik 5]'e göre ulusal yoksulluk sınırındaki kırsal yoksulluk sayısının 2002'den itibaren düzenli olarak azaldığı ülkeler Türkiye ve Tayland'dır. Meksika ise diğer verilerde görüldüğü gibi yüksek bir değere sahiptir¹.

¹ Arjantin ve G.Kore için veri eksikliği nedeniyle analiz yapmamaktayız.

Grafik 6. Ulusal Yoksulluk Sınırlarında Yoksulluk Oranı (Nüfusun% 'si)



[Grafik 6]'ya göre, ulusal yoksulluk sınırındaki nüfusun toplam nüfusa oranı açısından yapılan değerlendirmede, 2000 sonrası dönemde Türkiye'de istikrarlı bir azalmanın olması dikkat çekicidir. Bunu incelenen dönem içinde %25'lerden %10'ların altına gerileyen Tayland izlemektedir. Arjantin'in son dönem verilerinde %25'lerde bulunduğu, Meksika'nın ise 2008-2015 arasında %45 düzeyinde seyrettiği görülmektedir.

5.SONUÇ

Sürdürülebilir büyümeye en çok ihtiyaç duyan gelişmekte olan ülkelerde 1990'lar içinde yaşanan ekonomik krizlerin ortaya çıkış nedenleri ile ülkelerin bu krizler sonucu yoksullaştıklarını söyleyebiliriz. Diğer bölümlerde bahsedildiği gibi 1990'ların başında finansal kaynaklı küresel anlamda kriz yaşamış ülkelere sırasıyla Meksika (1994) ve Güney Kore (1997 – Güneydoğu Asya) ve Türkiye (2000 ve 2001) ekonomilerinin değiştiği oldukça açıktır. Çalışmada, ilk önce yaşanan krizin çıkışı ve seyri ele alınmış, sonra da bunun takip eden yıllar içinde istatistiksel veriler üzerindeki etkisine değinilmiştir. Bu ülkelerin sahip oldukları sanayi yapısına bakıldığında işgücünün büyük çoğunluğunun vasıfsız ve alt gelir grubunda kişiler olduğu görülmektedir. Eğer krizin reel sektördeki etkisi iyi kavranabilirse, bu ülke içindeki gelir dağılımı ve kişilerin yoksullaşması üzerindeki etkisi çok daha iyi anlaşılabilir.

Özetle, ele alınan dönem için tüm ülkelerdeki Gini katsayısı değerlerinin %55 ile %40 bandı içinde seyrettiği sonucu bulunmaktadır. Ayrıca günlük kazancı 1.90 ve 3.20 \$ altında olan nüfusun yıllar

içinde azalmasına rağmen günlük kazancı 5.50\$ altında olan nüfusun tüm ülkelerde yüksektir. Gini katsayısı ve Günlük kazancı 5.50\$ altındaki verileri birlikte yorumladığımızda, ülkelerdeki gelir dağılımı adaletsizliğini daha net olarak görebiliriz. Ayrıca, kırsal kesimdeki yoksul nüfusun ülke genelindeki toplam yoksul nüfusa oranında görülen azalmayı olumlu olarak değerlendirmek mümkün olmakla birlikte, kırsal kesimden şehre göç ile tarım alanlarının mülkiyet değişimleri gibi sosyo-ekonomik faktörlerin de bunda payının olabileceğini göz önünde bulundurmak yerinde olacaktır. Son olarak, ulusal yoksulluk sınırının altında kalan ülkeler sıralamasında Türkiye'nin üst sıralarda yer alması, ülkemiz açısından yoksullukla mücadelede olumlu bir yol kat edildiği şeklinde yorumlanabilir. Ardından Tayland, Türkiye'ye benzer bir duruma sahipken Latin Amerika ülkelerinde durumun daha kötü olduğu eldeki kısıtlı verilere dayanarak ifade edilebilir.

KAYNAKÇA

- Çalışkan, Ş. (2010) "Türkiye'de Gelir Eşitsizliği Ve Yoksulluk", Sosyal Siyaset Konferansları, Sayı: 59, 2010/2: 89-132.
- Çiğdem, H. (2016) "Gelişmekte Olan Ülkelerde Finansal Krizlere Neden Olan Faktörler: Türkiye Örneği", Basılmamış Yüksek Lisans Tezi, T.C. Niğde Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İktisat Ana Bilim Dalı İktisat Bilim Dalı, Niğde
- Dama, N. (2017) "Dünya Yoksullukla Mücadele Günü'nün 25. Yılında Türkiye'nin Yoksulluk Karnesi", Seta Perspektif, Ekim, 182: 1-7
- Danışoğlu, Ç. A. (2007) "Para Krizleri: Türkiye'de Yaşanmış Krizlerin Değerlendirilmesi", Sosyal Bilimler Dergisi 2: 1-11.
- Engin, B. (2007) "Gelişmiş Ve Yükselen Piyasalarda 1990 Sonrası Görülen Finansal Krizler Ve Dünya Ekonomisi Üzerindeki Etkileri" Sosyal Bilimler Dergisi, 2: 35-60.
- Eren, M. F. (2010) "Ekonomik Krizler Ve Kriz Göstergeleri: 1990 Sonrası Dünyada Yaşanan Krizler Ve Türkiye Karşılaştırması", Basılmamış Yüksek Lisans Tezi, Selçuk Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İşletme Anabilim Dalı Yönetim Organizasyon Bilim Dalı, Konya.
- Hyman, David N. (1983) "Public Finance", Chicago: The Dryden Press.
- Memiş, H. (2014) "Küreselleşme ve Yoksulluk İlişkisi", Akademik Yaklaşımlar Dergisi, Bahar, 5 (1): 144-161.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Seyidođlu, H. (2003) “Uluslararası Mali Krizler, IMF Politikaları, Az Gelişmiş Ülkeler, Türkiye ve Dönüşüm Ekonomileri”, Dođuş Üniversitesi Dergisi, Temmuz, 4, (2): 141-156.

Ural, M. (2003) “Finansal Krizler ve Türkiye”, Dokuz Eylül Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi,18, (1): 11-28.

Üzümcü, A., Dikkaya, M. Ve Özyakışır, D. (2010) “Küresel Kriz, Küresel Yoksulluk ve İşsizlik Sorunu: Sistem İçi Restorasyon Yeterli mi?”, Finans Politik &Ekonomik Yorumlar, 47, (545): 9-19.

Yanar, R. Ve Şahbaz, A. (2013) “Gelişmekte Olan Ülkelerde Küreselleşmenin Yoksulluk ve Gelir Eşitsizliği Üzerine Etkileri”, Eskişehir Osmangazi Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, Aralık, 8 (3): 55-74.

Yiğit, D. (2013) “Küresel Ekonomik Krizin Türkiye ve Orta Asya Türk Cumhuriyetleri’nde Ekonomik Büyüme”, İşgücü Piyasası ve Yoksullukla Mücadele Süreci Üzerine Etkileri Raporu, Ahmet Yesevi Üniversitesi, İnceleme Araştırma Dizisi, Yayın No: 13, Ankara.



**ÖZ KENDİLİK DEĞERLENDİRMESİNİN PRESENTEEİSM ÜZERİNDE ETKİSİNDE
ÇALIŞMAYA TUTKUNLUĞUN ARACILIK ROLÜ**

Ali ACARAY^{2*}

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, öz kendilik değerlendirmesinin presenteeism üzerinde etkisinde çalışmaya tutkunluğun aracılık rolünü incelemektir. Araştırmanın örneklemini İstanbul'daki çeşitli banka, iletişim, otel ve restoran gibi hizmet sektörü kurumlarından ankete katılan 293 satış çalışanı oluşturmaktadır. Kolayda örnekleme yöntemiyle toplanan veriler yapısal eşitlik modellemesi ile analiz edilmiştir. Araştırmanın bulguları öz kendilik değerlendirmesinin presenteeism ve çalışmaya tutkunluk üzerinde pozitif; çalışmaya tutkunluğun presenteeism üzerinde pozitif ve çalışmaya tutkunluğun ise öz kendilik değerlendirmesi ile presenteeism arasındaki ilişkide tam aracı role sahip olduğunu ortaya koymuştur.

***Anahtar Kelimeler:** Öz Kendilik Değerlendirmesi, Çalışmaya Tutkunluk, Presenteeism, Hizmet Sektörü*

***JEL Kodu:** M10, M12, M20*

THE MEDIATING ROLE OF WORK ENGAGEMENT ON THE EFFECT OF CORE SELF-EVALUATION ON JOB PRESENTEEISM

ABSTRACT

The purpose of this paper is to investigate the mediating role of work engagement on the effect of core self-evaluation on job presenteeism. The sample of the study consists of 293 sales employees of service sector institutions such as various banks, communication, hotels and restaurants in Istanbul. The data collected by convenience sampling method was analyzed by structural equation modeling. The findings of the study showed that core self-evaluation had a positive effect on work engagement and presenteeism; work engagement had a positive effect on presenteeism, and work engagement had a full mediating role in the relationship between core self-evaluation and presenteeism.

***Keywords:** Core Self-Evaluation, Job Engagement, Presenteeism, Service Sector*

***JEL Code:** M10, M12, M20.*

* Recep Tayyip Erdoğan Üniversitesi, Fındıklı Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Fındıklı/Rize, Türkiye, aliacaray@gmail.com

1. GİRİŞ

Günümüzün artan rekabetçi iş ortamında örgütlerin varlıklarını sürdürebilmesi için şirket birleşmeleri, satın almalar, küçülme, dış kaynak kullanımı, esnek örgütlenme gibi çeşitli yeniden yapılanmalara gitmeleri çalışanların üzerinde çeşitli baskılara neden olmaktadır. Örgütler bu yeni durumlarda da çalışanlarından daha başarılı, üretken, yenilikçi ve yaratıcı olmalarını beklemektedir. Aksi takdirde başta iş kaybı olmak üzere örgüt düzeyinde de çeşitli baskılarla karşılaşabilmektedirler. Dolayısıyla çalışanlar baskılardan ve ortaya çıkardığı stresli ortamlardan kendilerini korumak için sağlık sorunlarına rağmen işine devam etmektedirler. Başka bir ifade ile hasta olmalarına rağmen işe gitmeyi sürdürmektedirler. Bu durum yazında presenteeism olarak adlandırılmakta olup ciddi bir çalışan davranışı şeklinde ortaya çıkmaktadır. Presenteeism üzerinde etkili iki temel değişkenin etkileri incelenecektir. Ayrıca öz kendilik değerlendirmesinin presenteeisme etkisinde çalışmaya tutkunluğun aracılık rolü değerlendirilecektir.

2. KAVRAMSAL ÇERÇEVE VE HİPOTEZLER

2.1. Öz Kendilik Değerlendirmesi

Kendilik kavramı, bireyin sahip olduğu tecrübesiyle ve etrafını yorumlamasıyla şekillenen kendisi hakkındaki bakış açısını ifade eder (Şeşen, 2010). Öz kendilik değerlendirmesi ise, bireylerin kendi değer, yetenek ve kapasitelerine yönelik olarak yaptıkları değerlendirmelerle alakalı bir kavramdır (Judge, Locke ve Durham, 1997). Judge, Erez ve Bono (1998) ise “bireylerin kendileri ve dünyadaki işleyişleri hakkında sahip oldukları temel öncüler” olarak tanımlamıştır. Son yıllarda bir kişilik özelliği olarak öz kendilik değerlendirmesi çalışan davranış ve tutumlarıyla ilişkili yapılara dair ilgili araştırmalarda dikkat çekmektedir (Bipp, 2010). Öz kendilik değerlendirmesi benlik saygısı, öz yeterlik, kontrol odağı ve duygusal denge özelliklerini bir arada barındıran daha üst düzey bir bileşen kavram olarak ele alınır. Kavram, bireyin kendisinin değerli, yeterli ve yetenekliliğine ilişkin ortaya koyduğu değerlendirmeler üzerine temellendirilmiştir (Judge, Bono, Erez ve Locke, 2005).

Öz yeterlilik, çalışanın performans icra ederken bireysel yetenek ve kabiliyetlerine olan inancıdır (Brunborg, 2008). Özsaygı, bireyin kendisini ne derecede yeterli, değerli ve önemli olarak gördüğüne ilişkin algılama düzeyidir (Gürbüz, Erkuş ve Sığı, 2010; Judge ve Bono, 2001). Duygusal denge; bireyin kendine güvenen, eleştiriye açık, sakin yapılı ve stresle mücadele edebilmesini ifade eder (Bruck ve Allen, 2003; Costa ve McCrae, 1995). Kontrol odağı ise kişinin yaşamında elde ettiği sonuçların kendi davranışlarından mı yoksa kendisi dışındaki güçlerden mi kaynaklandığına ilişkin olarak kendisine dair geliştirdiği inancıdır (Spector, 1988).

2.2. Presenteeism

Örgütsel yazında presenteeism, çalışanların hastalık ya da diğer sağlıkla ilgili durumlarından ötürü tam performanslı olarak çalışmamasına rağmen işine devam etmesi durumudur (Martinez ve Ferreira, 2012). Başka bir tanımlamaya göre presenteeism, çalışanın kendisini hasta hissetmesine rağmen işine gitmeye devam etme eylemidir (Aronsson, Gustafsson ve Dallner, 2000; Johns, 2010). Presenteeism, çalışma saatlerinde işyerinde bulunmama anlamına gelen devamsızlığın karşıtlığından ortaya çıkmıştır. Presenteeism, büyük zorluklar ve işgücü eksiklikleri ile karşı karşıya olan örgütler için bir rekabet avantajı olarak görünse de, yapılan araştırmalar, sağlıklı değil iken işte bulunmanın verimlilik, performans ve hizmet kalitesi açısından devamsızlıktan daha fazla bir maliyet oluşturabileceğini göstermiştir (Burton, Chen, Conti, Schultz ve Edington, 2006; Robertson ve Cooper, 2011).

2.3. Çalışmaya Tutkunluk

Örgütsel davranış yazınının popüler konularından biri olan (Saks, 2006) çalışmaya tutkunluk, ilk olarak Kahn (1990) tarafından çalışanların görev performanslarına kendilerini fiziki, duygu ve zihin yönünden vermeleri olarak ifade edilmiştir. Çalışmaya tutkunluk, çalışanın sahip olduğu “pozitif, tatmin edici, çalışmayla ilgili ruh hali” (Schaufeli, Salanova, González-Romá ve Bakker, 2002) olarak da tanımlanmaktadır. Çalışmaya tutkunluktaki temel konu, çalışma fiilinin çalışanlarda oluşturduğu tatmin duygusundaki ruh halleridir (Schaufeli, Bakker ve Salanova, 2006). Çalışmaya tutkunluk, motivasyonel bir süreç olarak ele alınarak Schaufeli ve arkadaşlarının (2002) çalışmasında dinçlik, adanmışlık ve yoğunlaşmanın oluşturduğu üçlü bir yapıda ele alınmaktadır. Çalışmaya tutkun çalışanlar, işlerinden zevk almakta, daha iyi performans göstermekte ve yüksek bir örgütsel bağlılık içerisinde olmaktadır (Hakanen, Bakker ve Schaufeli, 2006; Salanova, Agut ve Peiró, 2005).

Hipotezler:

H₁: Öz kendilik değerlendirmesi presenteeism üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir.

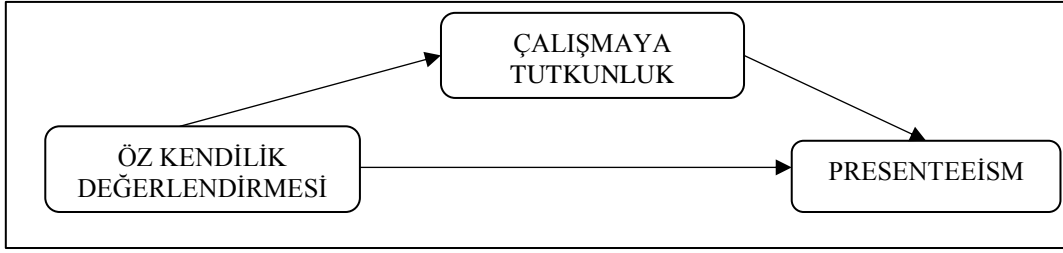
H₂: Öz kendilik değerlendirmesi çalışmaya tutkunluk üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir.

H₃: Çalışmaya tutkunluk presenteeism üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir.

H₄: Çalışmaya tutkunluk öz kendilik değerlendirmesi ile presenteeism arasındaki ilişkide aracılık etkisine sahiptir.

Öz kendilik değerlendirmesi, çalışmaya tutkunluk ve presenteeism arasında olduğu düşünülen ilişkileri ortaya koymak için ileri sürülen hipotezleri kapsayan araştırmanın modeli Şekil 1’de görülmektedir.

Şekil 1. Araştırmanın Modeli



3. YÖNTEM

3.1. Araştırmanın Örneklem Süreci

Araştırmanın örneklemini İstanbul'daki çeşitli banka, iletişim, otel ve restoran gibi hizmet sektörü kurumlarından ankete katılan 293 satış çalışanı oluşturmaktadır. Veriler kolayda örnekleme yöntemiyle toplanmıştır. Araştırmaya katılan örneklemin, % 62'si erkek, % 66'sı lisans ve üstü mezun, ortalama yaş 31,84, % 56'sı evli olup; % 85'i alt düzey olarak çalışmaktadır.

3.2. Araştırma Ölçeklerinin Oluşturulması

Araştırmaya katılanların demografik bilgilerini öğrenmek için çeşitli sorular sorulmuştur. Öz kendilik değerlendirmelerinin ölçümünde Judge ve arkadaşları (2003) tarafından geliştirilen Şeşen (2010) tarafından Türkçeye uyarlanan 12 ifadeli öz kendilik değerlendirme ölçeği kullanılmıştır. Ölçek, özsaygı, öz yeterlik, kontrol odağı ve duygusal denge boyutlarını içermektedir. Bu ölçekteki sorulardan birisi "Hayatta hak ettiğim başarıyı elde edeceğim konusunda kendimden eminim" şeklindedir. Ölçekteki olumsuz ifadeler ters kodlanmıştır. Şeşen'in (2010) yapmış olduğu çalışmada öz kendilik değerlendirme ölçeğinin güvenilirliği 0,82 olarak bulunmuştur.

Presenteeizmin ölçümünde Koopman ve arkadaşları (2002) tarafından geliştirilen 6 maddeli Stanford presenteeizm ölçeği kullanılmıştır. Bu ölçekte sorulan sorulardan biri de "Eğer hastalanırsam, zor durumda olmama rağmen tüm işlerimi tamamlayabilecek kadar kendimi enerjik hissederim" Koopman ve arkadaşları (2002) çalışmalarında ilgili ölçeğin güvenilirliğini 0,80 olarak tespit etmişlerdir.

Çalışmaya tutkunluğun ölçümünde Schaufeli ve arkadaşları (2002) tarafından geliştirilen 17 maddeli Utrecht Work Engagement Scale (UWES) ölçeği ile ölçülmüştür. Bu ölçekteki sorulan sorulardan birisi "Yaptığım işin anlamı ve amacı olduğunu düşünüyorum" şeklindedir. Turgut'un (2011) çalışmasında dinçlik alt boyutunun güvenilirliği 0,81, adanmışlık alt boyutunun güvenilirliği 0,87 ve yoğunlaşma alt boyutunun güvenilirliği ise 0,86 olarak tespit edilmiştir.

Ankette katılımcıların ölçeklerdeki ifadelerle ilişkin algılamalarının ölçülmesi, 1=Kesinlikle katılmıyorum ve 5=Kesinlikle katılıyorum şeklinde 5'li likert tipinde hazırlanan ölçeklerle yapılmıştır.

4. BULGULAR

4.1. Değişkenlerin Geçerlilik ve Güvenilirlik Analizleri ve Hipotez Testleri

Ölçeklerin geçerlilik ve güvenilirlikleri, doğrulayıcı faktör analizi ile (CFA) ortaya konulmuştur. Üç adet çalışmaya tutkunluk değişkenine ait sorular faktör yüklerinin düşük çıkması nedeniyle analize katılmamıştır. Kalan ifadelerin faktör yükleri 0,525 ile 0,913 arasında değişmektedir. Değişkenler için hesaplanan ortalama varyans (AVE) değerleri 0,50 ile 0,75; bileşik güvenilirlik değerleri (CR) 0,85 ile 0,91 ve Cronbach Alfa değerleri ise 0,79 ile 0,89 arasında yer alarak eşik değerleri geçmektedir. Tablo 1'deki parantez içindeki değerler araştırmanın temel değişkenlerinin ayırma geçerliliğine ilişkin olup, bir problem bulunmamaktadır.

İlişkileri ortaya koymak amacıyla korelasyon analizi yapılmıştır. Korelasyon analizinde, modeldeki değişkenlerin aralarında anlamlı ve çift yönlü ilişkiler ortaya çıktığı görülmüştür (Tablo 1).

Tablo 1. Ortalama, Geçerlilik ve Güvenilirliğe İlişkin Değerler

| Sıra | Değişkenler | Ort. | 1 | 2 | 3 |
|------|-----------------------------|------|-------|-------|-------|
| 1 | Öz Kendilik Değerlendirmesi | 3,97 | (.75) | | |
| 2 | Presenteeism | 3,52 | ,17** | (.67) | |
| 3 | Çalışmaya Tutkunluk | 3,88 | ,71** | ,30** | (.87) |
| | α | | ,791 | ,845 | ,791 |
| | CR | | ,851 | ,903 | ,913 |
| | AVE | | ,538 | ,751 | ,510 |

N: 293, * p < .05, **p < .01

Araştırma modelinde yer alan faktörlerin karşılıklı ilişkilerini incelemeyi takiben hipotezlerde öngörülen doğrusal ilişkiler yapısal eşitlik modeli dâhilinde yol analizleri ile test edilmiştir. Yapılan analiz sonuçlarına göre;

- Öz kendilik değerlendirme presenteeism üzerinde ($\beta = ,20$, $p < 0,01$) üzerinde pozitif ve istatistiksel olarak anlamlı bir etkiye sahiptir. Dolayısıyla H1 hipotezi kabul edilmiştir.
- Öz kendilik değerlendirme çalışmaya tutkunluk üzerinde ($\beta = ,70$, $p < 0,01$) üzerinde pozitif ve istatistiksel olarak anlamlı bir etkiye sahiptir. Dolayısıyla H2 hipotezi kabul edilmiştir.
- Çalışmaya tutkunluk presenteeism üzerinde ($\beta = ,37$, $p < 0,01$) üzerinde pozitif ve istatistiksel olarak anlamlı bir etkiye sahiptir. Dolayısıyla H3 hipotezi kabul edilmiştir.

SmartPLS programı kullanılarak aracı değişkenin rolünün sınanmasında toplam etki yöntemi izlenmiştir. Aracı değişken etkisinin testinde dolaylı etkilerin anlamlılığı hem aracı değişkenlerin yokluğunda (C yolu ile belirtilen toplam etki) hem de varlığında (C' yolu ile belirtilen direk etki) sınanmalıdır. Baron ve Kenny (1986) tarafından ortaya konulan 3 aşamalı prosedürü bu düşünceye

dayalıdır: bağımsız değişken bağımlı değişkeni etkilemelidir; bağımsız değişken aracı değişkeni etkilemelidir ve bağımsız değişken kontrol edildikten sonra, aracı değişkenin bağımsız değişken ile bağımlı değişken arasındaki ilişkiye dahil edilmesi durumunda bağımsız değişkenin bağımlı değişken üzerindeki etkisi farklılaşmalıdır.

Tablo 2’de, bağımsız ve bağımlı değişken arasında aracı değişkenlerin olması durumundaki dolaylı etkiler görülmektedir. Öz kendilik değerlendirmesi ile presenteeism arasında dolaylı ilişki anlamlı olarak ortaya çıkmıştır.

Tablo 2. Yapısal Modeldeki Dolaylı Etkiler

| İlişki | | Dolaylı Etki (β) | |
|--------------------------------|-----------------------|-----------------------------|--------|
| Öz Kendilik Değerlendirmesi -> | Çalışmaya Tutkunluk-> | Presenteeism | .264** |

Öz kendilik değerlendirmesi ile presenteeism arasındaki ilişkide çalışmaya tutkunluğun aracı değişken etkisini sınamak için yapılan aracı değişken testinde, çalışmaya tutkunluk presenteeism üzerinde 0,264 beta katsayısı ile öz kendilik değerlendirmesinin presenteeisme etki düzeyinden daha fazla etkiye sahip olarak tam aracılık rolü üstlenmiştir. Başka bir ifade ile öz kendilik değerlendirmesinin presenteeisme olan 0,200 katsayısı, aracı değişkenin varlığında 0,264 olarak ortaya çıkmıştır. Dolayısıyla H4 hipotezi desteklenmiştir.

5.TARTIŞMA

Yazında presenteeism davranışının ortaya çıkması üzerinde etkili öncüllerin incelenmesi önemli konular arasında güncelliğini sürdürmektedir. Hem çalışanlar hem de örgütler nezdinde başta performans düşüklüğü olmak üzere, verimlilik düzeylerinde azalma gibi olumsuz sonuçlar ortaya çıkarabilmektedir. Dolayısıyla ciddi olumsuz sonuçları beraberinde getiren böyle bir davranışın tetikleyici faktörlerini incelemek önemlidir. Presenteeismın ortaya çıkışında çalışanların kişisel özellikleri bağlamında öz kendilik değerlendirmesi bağımsız bir değişken olabilmektedir. Çünkü bireyin kendisine yönelik yaptığı değerlendirmenin neticesinde presenteeism ortaya çıkabilmektedir. Ayrıca bu iki değişken arasında çalışmaya tutkunluk önemli bir aracılık rolüne sahip olabilmektedir.

6.SONUÇ

Çalışanların, değişkenlere ilişkin algılamaları değerlendirildiğinde, öz kendilik değerlendirmesi ve çalışmaya tutkunluk katılıyorum düzeyine yakın olup ortalamanın üzerindedir. Presenteeism düzeyleri ise karasızım ile katılıyorum arasında olup, ortalamanın üzerinde olarak ortaya çıkmıştır.

Çalışmada ulaşılan bulgulardan birisi, öz kendilik değerlendirmesi presenteeism üzerinde pozitif olarak etkilidir. Dolayısıyla çalışmada ulaşılan bu bulgu, Ma, Meltzer, Yang ve Liu'nun (2017) çalışmalarında bireysel motivasyonun özyeterlilik, sorumluluk, içsel kontrol odaklılık gibi belirleyicilerin presenteeism davranışında önemli rol oynayabileceğine dair ifadelerini desteklemektedir.

Çalışmada ulaşılan bulgulardan bir diğeri, çalışmaya tutkunluk presenteeism üzerinde pozitif olarak etkili olduğudur. Bu sonuç Yıldız'ın (2016) yaptığı çalışmada işe adanmışlığın presenteeismi artırmakta olduğu sonuç ile tutarlıdır.

Çalışmaya tutkunluğun aracılık rolüne ilişkin ulaşılan bulguda ise, çalışmaya tutkunluk öz kendiliğin presenteeism üzerindeki etkisinde tam aracılık rolü üstlenmiştir. Çalışmaya tutkunluk presenteeismi güçlendiren bir değişken olarak ortaya çıkmıştır.

Yapılan bu çalışmanın yazına sağladığı katkılara yanında bazı kısıtları söz konusudur. Dolayısıyla ulaşılan bulgular, verilerin toplandığı örneklem kapsamında değerlendirilebilir. Sonraki çalışmalar bu çalışmanın tasarımına presenteeism sonuçlarına da ilişkin değişkenler ve motivasyon konusu da eklenerek farklı örneklerde yapılabilir.

KAYNAKÇA

Aronsson, G., Gustafsson, K. ve Dallner, M. (2000) "Sick But Yet at Work. An Empirical Study of Sickness Presenteeism", *Journal of Epidemiology and Community Health*, 54:502-509.

Baron, R. M. ve Kenny, D. A. (1986) "The Moderator-Mediator Variable Distinction in Social Psychological Research: Conceptual, Strategic, and Statistical Considerations", *Journal of Personality and Social Psychology*, 51(6):1173-1182.

Bip, T. (2010) "What Do People Want From Their Jobs? The Big Five, Core Self-Evaluations and Work Motivation", *International Journal of Selection and Assessment*, 18(1):28-39.

Bruck, C. S. ve Allen, T. D. (2003) "The Relationship Between Big Five Personality Traits, Negative Affectivity Type A Behavior and Work-Family Conflict", *Journal of Vocational Behavior*, 6: 457-472.

Brunborg, G. S. (2008) "Core Self-evaluations: A Predictor Variable for Job Stress", *European Psychologist*, 13(2): 96-102.

Burton, W. N., Chen, C.-Y., Conti, D. J., Schultz, A. B. ve Edington, D. W. (2006) "The Association Between Health Risk Change and Presenteeism Change", *Journal of Occupational and Environmental Medicine*, 48:252-263.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Costa, P. T. ve McCrae, R. R. (1995) "Domains and Facets: Hierarchical Personality Assessment Using The Revised NEO Personality Inventory", *Journal of Personality Assessment*, 64: 21-50.

Gürbüz, S., Erkuş, A. ve Sığırı, Ü. (2010) "İş Tatmini ve İş Performansının Yeni Öncülü: Temel Benlik Değerlendirmesi", *Sosyal ve Beşeri Bilimler Dergisi*, 2(1): 69-76.

Hakanen, J.J., Bakker, A.B. ve Schaufeli, W.B. (2006) "Burnout and Work Engagement Among Teachers", *Journal of School Psychology*, 43(6): 495-513.

Johns, G. (2010) "Presenteeism in the Workplace: A Review and Research Agenda", *Journal of Organizational Behavior*, 31: 519-542.

Judge, T. A., Locke, E. A. ve Durham, C. C. (1997) "The Dispositional Causes of Job Satisfaction: A Core Evaluations Approach", *Research in Organizational Behavior*, 19,151-188.

Judge, T.A., Erez, A. ve Bono, J.E. (1998) "The Power of Being Positive: The Relation between Positive Self-concept and Job Performance", *Human Performance*, 11, 167-187

Judge, T. A., Erez, A., Bono, J. E. ve Thoresen, C. J. (2003) "The Core Self- Evaluations Scale: Development of A Measure", *Personnel Psychology*, 56(2): 303-331.

Judge, T. A., Bono, J. E., Erez, A. ve Locke, E. A. (2005) "Core self-Evaluations and Job and Life Satisfaction: The Role of Self-Concordance and Goal Attainment", *Journal of Applied Psychology*, 90(2): 257-268.

Judge, T. A. Bono, J. E. (2001) "Relationship of Core Self-Evaluations Traits-Self-Esteem, Generalized Selfefficacy, Locus of Control, and Emotional Stability-with Job Satisfaction and Job Performance: A Meta Analysis", *Journal of Applied Psychology*, 86(1): 80-92.

Kahn, W. A. (1990) "Psychological Conditions of Personal Engagement and Disengagement at Work", *Academy of Management Journal*, 33(4):692-724.

Koopman, C., Pelletier, K.R., Murray, J.F., Sharda, C.E., Berger, M.L., Turpin, R.S., Hackleman, P., Gibson, P., Holmes, D.M. ve Bendeli, T. (2002) "Standford Presenteeism Scale: Health Status and Employee Productivity", *Journal of Occupational and Environmental Medicine*, 44(1): 14-20.

Ma, J., Meltzer, D., Yang, L.-Q. ve Liu, C. (2017) "Motivation and Presenteeism: The Whys and Whats", In Luo Lu and Cary Cooper (Eds) *Presenteeism at Work*, Cambridge University Press.

Martinez, L. F. ve Ferreira, A. I. (2012) "Sick at Work: Presenteeism among Nurses in a Portuguese Public Hospital", *Stress and Health*, 28, 297-304.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Robertson, I. ve Cooper, C. L. (2011) "Well-being: Productivity and Happiness at Work", Hampshire, UK: Palgrave Macmillan.

Saks, A. M. (2006) "Antecedents and Consequences of Employee Engagement", Journal of Managerial Psychology, 21(7): 600-619.

Salanova, M., Agut, S. ve Peiró, J.M. (2005) "Linking Organizational Resources and Work Engagement to Employee Performance and Customer Loyalty: The Mediation of Service Climate", Journal of Applied Psychology, 90(6): 1217-1227.

Schaufeli, W. B., Salanova, M., González-Romá, V. ve Bakker, A. B. (2002) "The Measurement of Engagement and Burnout: A Two Sample Confirmatory Factor Analytic Approach", Journal of Happiness Studies, 3: 71-92.

Schaufeli, W. B., Bakker, A. B., Salanova M. (2006) "The Measurement of Work Engagement With A Short Questionnaire A Cross-National Study", Educational And Psychological Measurement, 66(4): 701-716.

Spector, P. E. (1988) "Development of the Work Locus of Control Scale", Journal of Occupational Psychology, 61(4): 335-340.

Şeşen, H. (2010) "Öncülleri ve Sonuçları ile Örgüt İçi Girişimcilik: Türk Savunma Sanayinde Bir Araştırma", Yayımlanmamış Doktora Tezi, KHO Savunma Bilimleri Enstitüsü, Ankara.

Turgut, T. (2011) "Çalışmaya Tutkunluk: İş Yükü, Esnek Çalışma Saatleri, Yönetici Desteği ve İş-Aile Çatışması İle İlişkileri" Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, 25(3-4):155-179.

Yıldız, H. (2016) "İşime Tutkuyla Bağlıyım. Hasta Olsam Da Giderim", 24. Yönetim ve Organizasyon Kongresi Bildirileri, İstanbul, 593-601.

**PSİKOLOJİK İYİ OLUŞUN İŞ PERFORMANSI ÜZERİNDEKİ ETKİSİNDE ÖRGÜT
TEMELLİ ÖZSAYGI VE ÇALIŞMAYA TUTKUNLUĞUN ARACILIK ROLÜ**

Ali ACARAY*

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, psikolojik iyi oluşun iş performansı üzerindeki etkisinde örgüt temelli özsaygı ve çalışmaya tutkunluğun aracılık rolünün incelenmesidir. Araştırmanın örneklemini İstanbul'daki gıda, temizlik, kozmetik gibi çeşitli alanlarda faaliyet gösteren firmalardan ankete katılan 370 çalışan oluşturmaktadır. Kolayda örnekleme yöntemiyle toplanan veriler yapısal eşitlik modellemesi ile analiz edilmiştir. Araştırmanın bulguları psikolojik iyi oluşun iş performansı üzerine pozitif bir etkiye sahip olduğunu ve bu ilişkide örgüt temelli özsaygı ve çalışmaya tutkunluğun aracılık rolünü üstlendiğini ortaya koymuştur.

Anahtar Kelimeler: Psikolojik İyi Oluş, İş Performansı, Örgüt Temelli Öz Saygı, Çalışmaya Tutkunluk

JEL Kodu: M10, M12, M20

**THE MEDIATING ROLE OF ORGANIZATION BASED SELF-ESTEEM AND WORK
ENGAGEMENT ON THE EFFECT OF PSYCHOLOGICAL WELL-BEING ON JOB
PERFORMANCE**

ABSTRACT

The purpose of this paper is to examine the mediating role of organization self-esteem and work engagement on the effect of psychological well-being on job performance. The sample of the study consisted of 370 employees from various companies such as food, cleaning and cosmetics in Istanbul. The data collected by convenience sampling method was analyzed by structural equation modeling. The findings of the study revealed that psychological well-being had a positive effect on work performance and organization based self-esteem and work engagement had a mediating role in this relationship.

Keywords: Psychological Well-Being, Job Performance, Organization Based Self-Esteem, Work Engagement

JEL Code: M10, M12, M20

* Recep Tayyip Erdoğan Üniversitesi, Fındıklı Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Fındıklı/Rize, aliacaray@gmail.com

1.GİRİŞ

Örgütlerin belirsiz çevre koşullarında rekabetçi yapılarının ortaya çıkmasında ve sürdürülebilirliğinde en önemli rol çalışanlara düşmektedir. Çalışanların performansı yaşanan rekabete karşı koymada ve rekabette üstünlük sağlamada örgütler açısından belirleyici bir konumdadır. Ancak hedeflenen performansın ortaya konulması daima arzu edilen bir sonuç olması yanı sıra, bu arzunun gerçekleşmesi pek çok faktöre ve bu faktörlerin bir etkileşim kurabilme sürecine bağlı olmaktadır. Dolayısıyla çalışanların performans düzeyini pozitif olarak etkileyebilecek faktörlerin belirlenmesi önem kazanmaktadır. Bu çalışmada çalışanların performanslarında etkili olabilecek belirleyiciler olarak psikolojik iyi oluş, örgüt temelli özsaygı ve çalışmaya tutkunluk incelenmiştir.

2.KAVRAMSAL ÇERÇEVE VE HİPOTEZLER

2.1.Psikolojik İyi Oluş

Psikolojik iyi oluş, kişinin birey olarak amaçlı bir yaşam içerisinde olup olmadığı, amaçlarına ulaşmış olup olmadığı ve çevresindekilerle olan etkileşimlerinin niteliğine dair duyumsadıklarıdır (Ryff ve Keyes, 1995). Psikolojik iyi oluş, kişinin kendisine dair öznel tecrübesidir (Diener, 1994). Bireyler yaşamlarında başarabileceklerine yönelik kendilerine inanıyorlarsa, psikolojik iyi oluş düzeyleri de artacaktır (Wright, 2005). Ayrıca çalışanların psikolojik iyi oluşları sadece çalışanlar için değil aynı zamanda yöneticiler için de önemli bir konudur. Çünkü mutlu çalışanlar üretken sonuçlara neden olabilirken (Wright ve Staw, 1999) örgütlerdeki stresin de çalışanlar üzerinde depresyon, kaygı ve pek çok fiziksel problemler (Siu, Lu ve Spector, 2007) gibi olumsuz sonuçlara yol açabilmektedir. Dolayısıyla bu olumsuz sonuçların yöneticiler tarafından yönetilmesi gerekecektir.

2.2.Örgüt Temelli Özsaygı

Örgüt temelli özsaygı, özsaygı kavramının özel bir şekli olarak değerlendirilmektedir (Gardner, Van Dyne ve Pierce, 2004; Pierce ve Gardner, 2009). Kavram olarak özsaygı, bireyin kendi yeterliliği ve değerliliğine ilişkin olarak yaptığı değerlendirmesidir (Rosenberg, 1965). Örgüt temelli özsaygı ise, çalışanların örgütündeki rollerine katılarak ihtiyaçlarını karşılayabileceğine inandığı örgütteki durumyla ilgili sahip olduğu pozitif bir duygu ve bilinçtir. Çalışanların kendilerini örgütlerinde önemli, anlamlı ve değerli olarak algıladıkları durumdur (Xanthopoulou, Bakker, Kantas, Demerouti, Schaufeli, 2009). Pierce, Gardner, Cummings ve Dunham da (1989) örgüt temelli özsaygıyı, çalışanların örgütlerinde yerine getirdikleri görevlerin karşılığında kendi ihtiyaçlarını da karşılama durumundaki inanç düzeyi olarak ifade etmişlerdir. Örgüt temelli özsaygılarının yüksek olmasının bir sonucu olarak çalışanların örgütlerine yönelik olumlu tutumlara sahip olabilmeleri ve böylece yüksek performans göstermeleri beklenebilir (Lee, 2003).

2.3.Çalışmaya Tutkunluk

Yazındaki tartışmalarda hala güncelliğini sürdüren bir işyeri davranışı olarak çalışmaya tutkunluk, bir çalışmada “pozitif, tatmin edici, çalışmayla ilgili ruh hali” (Schaufeli, Salanova, González-Romá ve Bakker, 2002), başka bir çalışmada ise çalışanın işine karşı bağlılık ve özdeşleşme hali (Turgut, 2011) şeklinde ifade edilmektedir. Çalışmaya tutkun olanlar, enerjik, performans gösteren ve işini keyifle yerine getirenler olarak düşünüldükleri için (Özsoy, Filiz ve Semiz, 2013), buradaki esas konu çalışanların çalışma eyleminin verdiği tatmin duygusundaki ruh halleridir (Schaufeli, Bakker ve Salanova, 2006). Çalışmaya tutkunluk, motivasyonel bir süreç olarak dinçlik, adanmışlık ve yoğunlaşma şeklinde üçlü bir yapıda incelenmektedir (Schaufeli vd., 2002).

Tutkulu çalışanlar, görev performansında oldukça esnek olduklarından yüksek düzeyde zihinsel ve fiziksel enerji gösterirler, akıllarını ve ruhlarını işlerine katabilirler. İşlerine güçlü bir katılım sergilerler ve işlerinden güçlü bir tutku, ilham, heyecan ve meydan okuma duygusu elde ederler ve bunu işlerinde gösterirler. Bu özelliklerdeki çalışanlar için zamanın nasıl geçtiği fark edilmez ve dolayısıyla işlerine tamamen odaklanmışlardır (Schaufeli ve Bakker, 2004). Çalışmaya tutkulular, işlerinden zevk alır, daha iyi performans gösterir ve yüksek örgütsel bağlılık gösterirler (Hakanen, Bakker ve Schaufeli, 2006; Salanova, Agut ve Peiró, 2005).

2.4.İş Performansı

İş performansı, hem insan kaynakları hem de örgütsel davranış yazınında önemli bir yere sahip konulardan birisidir. Çalışan performansı, belirli bir zaman periyotunda belirlenmiş hedef ve standartları gerçekleştirmeye ilişkin icra ettiği eylem ve faaliyetlerin sonucunda elde ettiği sonuçlar şeklinde ifade edilmektedir (Bingöl, 2014). Çalışanların belirlenen hedeflere ulaşması durumunda yüksek performanslı, hedeflenenin altında kalması durumunda ise düşük performanslı olarak adlandırılmaktadır. Çalışanların performansları bireysel ve örgütsel amaçların elde edilmesinde önemli bir belirleyicidir.

Hipotezler:

H₁: Psikolojik iyi oluş iş performansı üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir.

H₂: Psikolojik iyi oluş örgüt temelli özsaygı üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir.

H₃: Örgüt temelli özsaygı iş performansı üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir.

H₄: Örgüt temelli özsaygı psikolojik iyi oluş ile iş performansı arasındaki ilişkide aracılık etkisine sahiptir.

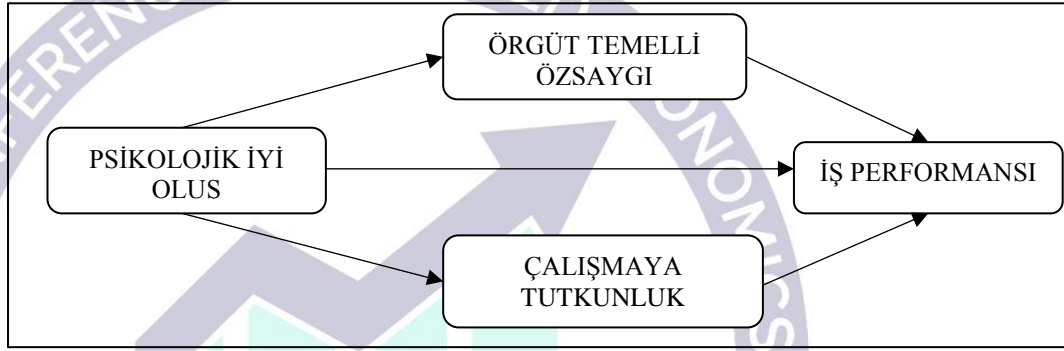
H₅: Psikolojik iyi oluş çalışmaya tutkunluk üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir.

H₆: Çalışmaya tutkunluk iş performansı üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir.

H₇: Çalışmaya tutkunluk psikolojik iyi oluş ile iş performansı arasındaki ilişkide aracılık etkisine sahiptir.

Psikolojik iyi oluş, örgüt temelli özsaygı, çalışmaya tutkunluk ve iş performansı arasında olduğu düşünülen ilişkileri ortaya koymak için ileri sürülen hipotezleri kapsayan araştırmanın modeli Şekil 1'de görülmektedir.

Şekil 1. Araştırmanın Modeli



3.YÖNTEM

3.1.Araştırmanın Örnekleme Süreci

Araştırmanın örneklemini İstanbul'daki gıda, temizlik, kozmetik gibi çeşitli alanlarda faaliyet gösteren firmalardan anketle katılan 370 çalışan oluşturmaktadır. Veriler kolayda örnekleme yöntemiyle toplanmıştır. Araştırmaya katılan örneklemin, % 55'i erkek, % 69'u lisans mezunu, yaş ortalaması 32,98, % 61'i evli olup; % 79'u alt düzey olarak çalışmaktadır.

3.2.Araştırma Ölçeklerinin Oluşturulması

Psikolojik iyi oluşunun ölçümünde Diener ve arkadaşları (2010) tarafından geliştirilen 8 ifadeli tek faktörlü bir yapı içeren Psikolojik İyi Oluş ölçeği kullanılmıştır. Bu ölçekteki sorulardan birisi "Günlük olarak gerçekleştirdiğim rutin faaliyetlerim benim için memnuniyet vericidir" şeklindedir. Psikolojik iyi oluş ölçeğinin ilgili çalışmadaki güvenilirliği 0,87 olarak bulunmuştur.

Örgüt temelli özsaygının ölçümünde ise Pierce ve arkadaşları (1989) tarafından geliştirilen 10 maddeli tek boyutlu örgüt temelli özsaygı ölçeği kullanılmıştır. Bu ölçekteki sorulardan birisi

“Çalıştığım kurumda arkadaşlarımla uyumluyum” şeklindedir. İlgili çalışmada ölçeğin güvenilirliği 0,91 olarak tespit edilmiştir.

Çalışmaya tutkunluğun ölçümünde Schaufeli ve arkadaşları (2002) tarafından geliştirilen 17 maddeli 3 alt boyutlu Utrecht Work Engagement Scale (UWES) ölçeği ile ölçülmüştür. Bu ölçekteki sorulan sorulardan birisi “İşimde yolunda gitmeyen şeyler olduğunda bile azimle çalışmaya devam ederim” şeklindedir. Turgut (2011) tarafından yapılan çalışmada ölçeğin güvenilirlikleri dinçlik için 0,81, adanmışlık için 0,87 ve yoğunlaşma için ise 0,86 olarak tespit edilmiştir.

İş performansının ölçümünde ise öncesinde Kirkman ve Rosen’in (1999) daha sonra ise Sigler ve Pearson’un (2000) çalışmasında kullandıkları 4 ifadeli tek boyutlu iş performansı ölçeği kullanılmıştır. Bu ölçekteki sorulardan birisi “Sunduğum hizmet kalitesinde standartlara fazlasıyla ulaştığımdan eminim” şeklindedir. Çöl (2008) tarafından yapılan çalışmada ölçeğin güvenilirliği 0,82 olarak tespit edilmiştir.

Ankette katılımcıların ölçeklerdeki ifadelerle ilişkin algılamalarının ölçümlemesi, 1=Kesinlikle katılmıyorum ve 5=Kesinlikle katılıyorum şeklinde 5’li likert tipinde hazırlanan ölçeklerle yapılmıştır.

4.BULGULAR

4.1.Değişkenlerin Geçerlilik ve Güvenilirlik Analizleri ve Hipotez Testleri

Ölçeklerin geçerlilik ve güvenilirlikleri, doğrulayıcı faktör analizi ile (CFA) ortaya konulmuştur. Dört adet çalışmaya tutkunluk değişkenindeki soruların faktör yüklerinin düşük çıkması nedeniyle analize katılmamıştır. Çalışmaya tutkunluk değişkenindeki kalan ve diğer temel temel değişkenlerin ifadelerinin faktör yükleri 0,51 ile 0,86 arasında değişmektedir. Değişkenler için hesaplanan ortalama varyans (AVE) değerleri 0,51 ile 0,69; bileşik güvenilirlik değerleri (CR) 0,90 ile 0,93 ve Cronbach Alfa değerleri ise 0,84 ile 0,92 arasında yer alarak eşik değerleri geçmektedir. Tablo 1’deki parantez içindeki değerler ayrışma geçerliliğine ilişkin olup, bir problem bulunmamaktadır.

İlişkileri ortaya koymak amacıyla korelasyon analizi yapılmıştır. Korelasyon analizinde, modeldeki değişkenlerin aralarında anlamlı ve çift yönlü ilişkiler ortaya çıktığı görülmüştür (Tablo 1).

Tablo 1. Ortalama, Geçerlilik ve Güvenilirliğe İlişkin Değerler

| Sıra | Değişkenler | Ort. | 1 | 2 | 3 | 4 |
|------|-----------------------|------|-------|-------|-------|-------|
| 1 | Psikolojik İyi Oluş | 4,11 | (.73) | | | |
| 2 | İş Performansı | 4,07 | ,57** | (.83) | | |
| 3 | Çalışmaya Tutkunluk | 3,86 | ,38** | ,36** | (.69) | |
| 4 | Örgüt Temelli Özsaygı | 4,13 | ,52** | ,47** | ,51** | (.76) |
| | α | | ,874 | ,847 | ,898 | ,917 |

| | | | | |
|-----|------|------|------|------|
| CR | ,901 | ,897 | ,915 | ,931 |
| AVE | ,534 | ,686 | ,514 | ,575 |

N: 370, * p < .05, **p < .01

Araştırma modelinde yer alan faktörlerin karşılıklı ilişkilerin incelemesinden sonra, hipotezlerde öngörülen doğrusal ilişkiler yapısal eşitlik modeli dâhilinde yol analizleri ile test edilmiştir. Yapılan analiz sonuçlarına göre;

Psikolojik iyi oluş iş performansı üzerinde ($\beta = ,77, p < 0,01$) üzerinde pozitif ve istatistiksel olarak anlamlı bir etkiye sahiptir. Dolayısıyla H1 hipotezi kabul edilmiştir.

Psikolojik iyi oluş örgüt temelli özsaygı üzerinde ($\beta = ,72, p < 0,01$) pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir. Dolayısıyla H2 hipotezi kabul edilmiştir.

Örgüt temelli özsaygı iş performansı üzerinde ($\beta = ,20, p < 0,01$) pozitif ve anlamlı bir etkiye sahiptir. Dolayısıyla H3 hipotezi kabul edilmiştir.

Psikolojik iyi oluş çalışmaya tutkunluk üzerinde ($\beta = ,58, p < 0,01$) üzerinde pozitif ve istatistiksel olarak anlamlı bir etkiye sahiptir. Dolayısıyla H5 hipotezi kabul edilmiştir.

Çalışmaya tutkunluk iş performansı üzerinde ($\beta = ,08, p < 0,05$) üzerinde pozitif ve istatistiksel olarak anlamlı bir etkiye sahiptir. Dolayısıyla H6 hipotezi kabul edilmiştir.

SmartPLS programı kullanılarak aracı değişkenin rolünün sınanmasında toplam etki yöntemi takip edilmiştir. Aracı değişken etkisinin testinde dolaylı etkilerin anlamlılığı hem aracı değişkenlerin yokluğunda (C yolu ile belirtilen toplam etki) hem de varlığında (C' yolu ile belirtilen direk etki) sınanmalıdır. Baron ve Kenny (1986) tarafından ortaya konulan 3 aşamalı prosedürü bu düşünceye dayalıdır:

Bağımsız değişken bağımlı değişkeni etkilemelidir;

Bağımsız değişken aracı değişkeni etkilemelidir ve

Bağımsız değişken kontrol edildikten sonra, aracı değişkenin bağımsız değişken ile bağımlı değişken arasındaki ilişkiye dahil edilmesi durumunda bağımsız değişkenin bağımlı değişken üzerindeki etkisi farklılaşmalıdır.

Tablo 2'de, bağımsız ve bağımlı değişken arasında aracı değişkenlerin olması durumundaki dolaylı etkiler görülmektedir. Psikolojik iyi oluş ile iş performansı arasında dolaylı ilişkilerin her ikisi de anlamlı olarak ortaya çıkmıştır.

Tablo 2. Yapısal Modeldeki Dolaylı Etkiler

| İlişki | | | Dolaylı Etki (β) |
|------------------------|-------------------------|----------------|-----------------------------|
| Psikolojik İyi Oluş -> | Örgüt Temelli Özsaygı-> | İş performansı | .144** |
| Psikolojik İyi Oluş -> | Çalışmaya Tutkunluk -> | İş performansı | .050* |

Psikolojik iyi oluş ile iş performansı arasındaki ilişkide çalışmaya tutkunluk ile örgüt temelli özsaygının aracı değişken etkisini sınamak için yapılan aracı değişken testi istatistikleri Tablo 3 ve 4'te görülmektedir.

Tablo 3. Örgüt Temelli Özsaygının Aracı Değişken Testi

| Örgüt Temelli Özsaygının Aracı Olduğu İlişki | | Toplam Etki C yolu (β) | Toplam Etki C' yolu (β) | Etki Oranı |
|--|----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------|
| Psikolojik İyi Oluş -> | İş performansı | .771** | .590** | .18 |

Örgüt temelli özsaygı, psikolojik iyi oluş ile iş performansı arasındaki ilişkide kısmi aracı değişken rolü yüklenmekte olup, bu kısmi aracılığın etki oranı 0,18 olarak hesaplanmıştır. Dolayısıyla H4 hipotezi kısmen desteklenmiştir.

Tablo 4. Çalışmaya Tutkunluğun Aracı Değişken Testi

| Çalışmaya Tutkunluğun Aracı Olduğu İlişki | | Toplam Etki C yolu (β) | Toplam Etki C' yolu (β) | Etki Oranı |
|---|----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------|
| Psikolojik İyi Oluş -> | İş performansı | .771** | .672** | .06 |

Çalışmaya tutkunluk, psikolojik iyi oluş ile iş performansı arasındaki ilişkide kısmi aracı değişken rolü yüklenmekte olup, bu kısmi aracılığın etki oranı 0,06 olarak hesaplanmıştır. Dolayısıyla H7 hipotezi kısmen desteklenmiştir.

4.2.Tartışma

Yazında çalışanların iş performansı üzerinde etkili olabilecek faktörlerin incelenmesi önemli konular arasında ortaya çıkmaktadır. İş performansının artırılmasında örgütsel ve bireysel faktörler etkili olmaktadır. Bu çalışma kapsamında psikolojik iyi oluş, çalışmaya tutkunluk ve örgüt temelli özsaygı değişkenleri, iş performansı üzerinde etkili olan bağımsız ve aracı değişkenler olarak ortaya çıkmıştır. Özellikle psikolojik iyi oluş, iş performansının güçlendirilmesinde önemli bir güçlendirici

olup, çalışmaya tutkunluk ve örgüt temelli özsaygı da dikkate değer biçimde aracılık rolü üstlenmişlerdir.

5.SONUÇ

Çalışanların, araştırmanın temel değişkenlerine ilişkin algılamaları incelendiğinde, psikolojik iyi oluş, örgüt temelli özsaygı ve iş performansı düzeyleri katılıyorum ve kesinlikle katılıyorum arasında olup yüksek düzeye yakındır. Çalışmaya tutkunluk düzeyleri ise karasızım ile katılıyorum arasında olup, ortalamanın üzerinde olarak ortaya çıkmıştır. Dolayısıyla örneklemin değişkenlere ilişkin algılamaları yüksek seviyede pozitif olarak gerçekleşmiştir.

Çalışmanın en temel bulgusu, psikolojik iyi oluşun iş performansı üzerindeki pozitif etkisidir. Çalışanların amaçlı bir hayatın içinde olmaları, sosyal çevresindeki ilişkilerin memnuniyet verici seviyede olması ve geleceğe güvenli ve umutla bakılması mevcutta devam ettirilen işin performansı artırmaktadır. Wright ve Cropanzano (2000) tarafından yapılan çalışmada da psikolojik iyi oluşun iş performansı üzerinde yordayıcı bir etkiye sahip olduğu ortaya konulmuştur.

Çalışmada aracı değişkenlere ilişkin olarak ulaşılan bulgulardan birisi, örgüt temelli özsaygının psikolojik iyi oluş ile iş performansı arasında aracılık rolü üstlendiğidir. Psikolojik iyi oluşun iş performansı üzerindeki güçlü pozitif etkisinde örgüt temelli özsaygı kısmi pozitif olarak güçlendirici bir etkileyen olarak ortaya çıkmıştır. Yapılan bir meta-analiz çalışmasında, örgüt temelli özsaygı ile rol performansı arasında pozitif ilişkili olduğu ortaya konulmuştur (Bowling, Eschleman, Wang, Kirkendall ve Alarcon, 2010).

Çalışmada aracı değişkenlere ilişkin olarak ulaşılan diğer temel bulgularından birisi ise, çalışmaya tutkunluğun psikolojik iyi oluş ile iş performansı arasında kısmi pozitif olarak aracılık rolüne sahip olduğudur. Rich, Lepine ve Crawford (2010) tarafından yapılan çalışmada çalışmaya tutkunluk, öz kendilik değerlendirmesi ile görev performansı arasındaki ilişkide tam aracılık rolü üstlendiği ortaya konulmuştur.

Yapılan bu çalışma, diğer çalışmaların da olduğu üzere çeşitli kısıtlara sahiptir. Araştırma verileri sadece İstanbul'da özel sektördeki gıda, temizlik, kozmetik firmalarından ankete katılanlarla sınırlıdır. Yapılacak sonraki çalışmalarda farklı ve daha geniş örneklemler üzerinde bu çalışmanın değişkenleri yanında psikolojik iyi oluşun öncüllerinin de modelde olduğu araştırmalar yapılabilir.

KAYNAKÇA

- Baron, R. M. ve Kenny, D. A. (1986) "The Moderator-Mediator Variable Distinction in Social Psychological Research: Conceptual, Strategic, and Statistical Considerations", *Journal of Personality and Social Psychology*, 51(6):1173-1182.
- Bingöl, D. (2014) "İnsan Kaynakları Yönetimi", 9. Baskı, Ankara: Beta Basım Yayınları.
- Bowling, N. A., Eschleman, K. J., Wang, Q., Kirkendall, C. ve Alarcon, G. (2010) "A Meta-Analysis of the Predictors and Consequences of Organization-Based Self-Esteem", *Journal of Occupational and Organizational Psychology*, 83: 601-626.
- Çöl, G. (2008) "Algılanan Güçlendirmenin İşgören Performansı Üzerine Etkileri", *Doğuş Üniversitesi Dergisi*, 9(1): 35-46.
- Diener, E., Wirtz, D., Tov, W., Kim-Prieto, C., Choi, D., Oishi, S. ve Biswas-Diener, R. (2010) "New Well-Being Measures: Short Scales to Assess Flourishing and Positive and Negative Feelings", *Soc Indic Res*, 97:143-156.
- Diener, E. (1994) "Assessing Subjective Well-Being: Progress and Opportunities", *Social Indicators Research*, 31: 103-157.
- Gardner, D. G., Van Dyne, L. ve Pierce, J. L. (2004) "The Effects of Pay Level on Organization-Based Self-Esteem and Performance: A Field Study", *Journal of Occupational and Organizational Psychology*, 77(3):307-322.
- Hakanen, J.J., Bakker, A.B. ve Schaufeli, W.B. (2006) "Burnout and Work Engagement Among Teachers", *Journal of School Psychology*, 43(6): 495-513.
- Kirkman, B. L. ve Rosen, B. (1999) "Beyond Self-Management: Antecedents and Consequences of Team Empowerment", *Academy of Management Journal*, 42(1):58-74.
- Lee, J. (2003) "An Analysis of the Antecedents of Organization Based Self Esteem in Two Korean Banks", *Human Resources Management*, 14(6): 1046-1066.
- Özsoy, E. , Filiz, B. ve Semiz, T. (2013) "İşkoliklik Ve Çalışmaya Tutkunluk Arasındaki İlişkiyi Belirlemeye Yönelik Sağlık Sektöründe Bir Araştırma", *Sosyal ve Beşeri Bilimler Dergisi*, 5(2): 59-62.
- Pierce, J.L., Gardner, D.G., Cummings, L.L. ve Dunham, R.B. (1989) "Organization-based Self-Esteem: Construct Definition, Measurement, and Validation", *Academy of Management Journal*, 32: 622-648.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Pierce, J. L. ve Gardner, D. G. (2009) "Relationships of Personality and Job Characteristics with Organization-Based Self-Esteem", *Journal of Managerial Psychology*, 24(5):392-409.
- Rich, B. L., Lepine, J. A. ve Crawford, E. R. (2010) "Job Engagement: Antecedents and Effects on Job Performance", *Academy of Management Journal*, 53(3): 617-635.
- Rosenberg, M. (1965) "Society and The Adolescent Self-Image", Princeton, NJ: Princeton University Press.
- Ryff, C. D. ve Keyes, C. L. M. (1995), "The Structure of Psychological Well-Being Revisited", *Journal of Personality and Social Psychology*, 69: 719-727.
- Salanova, M., Agut, S. ve Peiró, J.M. (2005) "Linking Organizational Resources and Work Engagement to Employee Performance and Customer Loyalty: The Mediation of Service Climate", *Journal of Applied Psychology*, 90(6): 1217-1227.
- Schaufeli, W. B., Bakker, A. B., Salanova M. (2006) "The Measurement of Work Engagement With A Short Questionnaire A Cross-National Study", *Educational And Psychological Measurement*, 66(4): 701-716.
- Schaufeli, W.B. ve Bakker, A.B. (2004) "Job Demands, Job Resources and Their Relationship with Burnout and Engagement: A Multi-Sample Study", *Journal of Organizational Behavior* 25: 293-315
- Schaufeli, W. B., Salanova, M., González-Romá, V. ve Bakker, A. B. (2002) "The Measurement of Engagement and Burnout: A Two Sample Confirmatory Factor Analytic Approach", *Journal of Happiness Studies*, 3: 71-92.
- Sigler, T. V. ve Pearson, C. M. (2000) "Creating an Empowering Culture: Examining The Relationship between Organizational Culture and Perceptions of Empowerment", *Journal of Quality Management*, 5(1):27-52.
- Siu, O.L., Lu, C.Q. ve Spector, P.E. (2007) "Employees' Well-being in Greater China: The Direct and Moderating Effects of General Self-efficacy", *Applied Psychology: An International Review*, 56(2): 288-301.
- Turgut, T. (2011) "Çalışmaya Tutkunluk: İş Yükü, Esnek Çalışma Saatleri, Yönetici Desteği ve İş-Aile Çatışması İle İlişkileri" *Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi*, 25(3-4):155-179.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

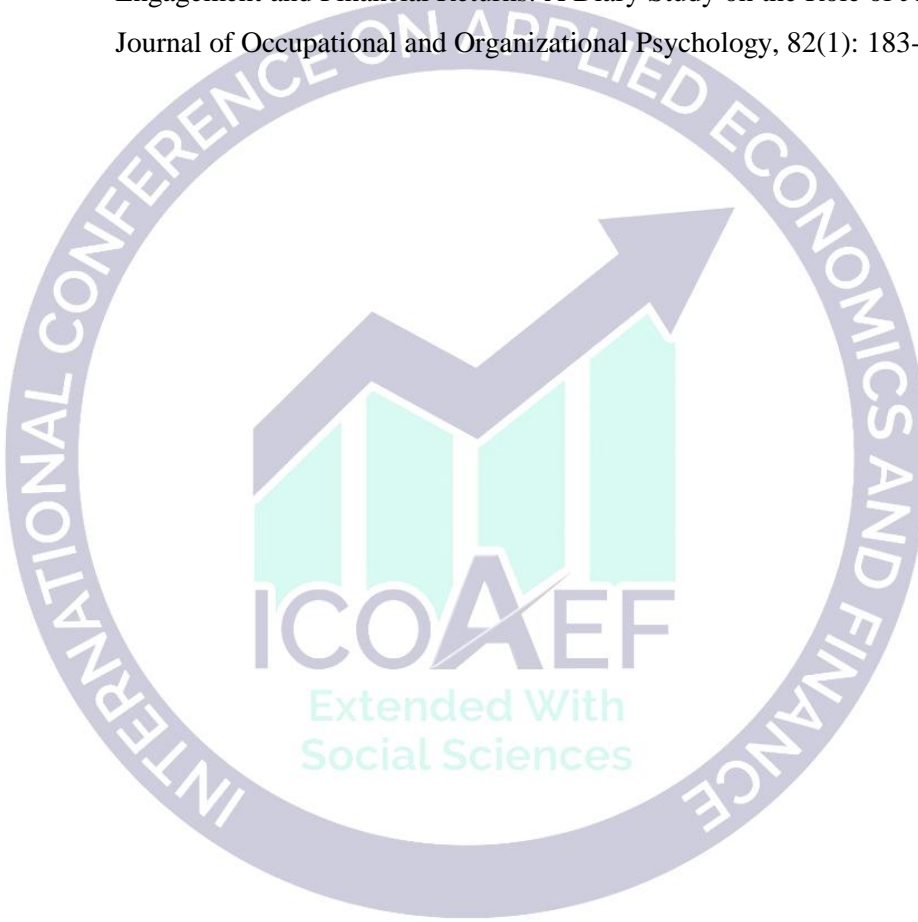
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Wright, T. A. (2005) "The Role of "Happiness" in Organizational Research: Past, Present and Future Directions", Perrewe, P. L. & Ganster, D. C. (Eds.), Research in Occupational Stress and Well-being, Amsterdam: JAI, 4, 225-268.

Wright, T. A. ve Cropanzano, R. (2000) "Psychological Well-being and Job Satisfaction as Predictors of Job Performance", Journal of Occupational Health Psychology, 5(1):84-96

Xanthopoulou, D., Bakker, A. B., Kantas, A, Demerouti, E. ve Schaufeli, W.B (2009) "Work Engagement and Financial Returns: A Diary Study on the Role of Job and Personal Resources", Journal of Occupational and Organizational Psychology, 82(1): 183-200.



FİNANSAL SAĞLIK SKORU ENDEKSİ: TR90 BÖLGESİ PİLOT UYGULAMASI¹

Doç. Dr. Alper Veli ÇAM*

Doç. Dr. Hasan AYAYDIN**

Dr. Öğr. Üyesi. Büşra TOSUNOĞLU***

Arş. Gör. Gül YEŞİLÇELEBİ****

Arş. Gör. Fatih AKDENİZ*****

ÖZET

Serbest piyasa ekonomisinin yaygınlık kazanmasıyla birlikte finansal farkındalığın önemi hızla artmıştır. Finans alanında eğitim almış insanların bile, günümüzün karmaşık finans dünyasında doğru kararlar almakta zorlanıyor olmaları bu durumun açık bir göstergesidir. Son yıllarda finansal piyasalarda meydana gelen gelişmeler, nüfus ile ilgili değişimler, ekonomik ve idari değişikliklerin hepsi finansal eğitimin ve finansal farkındalığın önemine işaret etmektedir.

Finansal farkındalığın artması ve bireylerin gelirlerini bilinçli şekilde yönetmesi ülke ekonomi açısından da önemlidir. Bu noktadan hareketle çalışmanın amacı tüm bireyler için kullanılacak ve finansal farkındalığı ortaya koyabilecek “Finansal Sağlık Skoru Endeksi” oluşturmaktır. Çalışma, TR90 bölgesini kapsamaktadır. Veriler anket yöntemi ile toplanmıştır. Çalışmada, Ekonomik Kalkınma ve İşbirliği Örgütü (OECD) tarafından geliştirilen ölçekten yararlanılmıştır. Çalışma sonucunda 8 ana değişkenden (finansal bilgi, finansal tavır, finansal davranış, borç düzeyi, gelir, bütçe uygulamaları, finansal erişim, tasarruf düzeyi) oluşan “Finansal Sağlık Skoru Endeksi” modeli oluşturulmuştur. Bu model, kanun koyuculara, finansal kurumlara ve bireylere özellikle planlama ve eğitim açısından önemli bir altyapı niteliği taşımaktadır.

Anahtar Kelimeler: *Finansal Eğitim, Finansal Farkındalık, Finansal Sağlık Skoru Endeksi*

JEL Kodları: *C90, C91. I22*

¹ Bu çalışma, Gümüşhane Üniversitesi Bilimsel Araştırma Projeleri Koordinatörlüğü'nce desteklenmiştir. Proje No: 17.F2911.02.02

* Gümüşhane Üniversitesi, İ.İ.B.F., İşletme Bölümü, Gümüşhane, Türkiye, alperc@gumushane.edu.tr

** Gümüşhane Üniversitesi, İ.İ.B.F., İşletme Bölümü, Gümüşhane, Türkiye, hayaydin61@gumushane.edu.tr

*** Gümüşhane Üniversitesi, İ.İ.B.F., İşletme Bölümü, Gümüşhane, Türkiye, busra.tosunoglu@gumushane.edu.tr

**** Gümüşhane Üniversitesi, İ.İ.B.F., İşletme Bölümü, Gümüşhane, Türkiye, gulyesilcelebi@gumushane.edu.tr

***** * Gümüşhane Üniversitesi, İ.İ.B.F., İşletme Bölümü, Gümüşhane, Türkiye, fatihakdeniz_61@hotmail.com

THE FINANCIAL HEALTH SCORE INDEX: A PILOT APPLICATION ON TR90 REGION

ABSTRACT

With the free market economy has been started to become prevalent, the importance of financial awareness has increased rapidly. It is a clear indication that even people who are educated in finance are having difficulty making the right decisions in today's complex finance world. Developments in the financial markets in recent years, changes in population, economic and administrative changes point to the importance of financial education and financial awareness.

Increasing financial awareness and managing the income of individuals consciously are also important in terms of the national economy. The aim of the study is to establish a "Financial Health Score Index" that can be used for all individuals and can be revealed financial awareness. The study covers the TR90 region. The data were collected by questionnaire method. In the study, the scale developed by the Organization for Economic Development and Cooperation (OECD) was utilized. As a result of the study, "Financial Health Score Index" model which consists of 8 main variables (Financial information, financial attitude, financial behavior, debt level, income, budget applications, financial access, level of savings) was established. This model is an important infrastructure for legislators, financial institutions and individuals, especially in terms of planning and education.

Keywords: *Financial Education, Financial Awareness, Financial Health Score Index*

JEL Codes: *C90, C91. I22*

1. GİRİŞ

Bireylerin finansal sistemle ilişkisinde finansal ürün ve hizmetlere erişim, finansal eğitim ve finansal tüketicinin korunması şeklinde üç temel alan ön plana çıkmaktadır. Finansal ürün ve hizmetlere erişim, hane halkı ve firmaların kredi, mevduat, sigorta, ödeme işlemleri gibi finansal ürün ve hizmetlere yeterli düzeyde ve uygun şartlarda ulaşabilmesini ve bunların kullanımını ifade etmektedir. Finansal eğitim, tüketici ve yatırımcıların bilgilendirilmeleri yoluyla finansal ürünlere, kavramlara ve risklere yönelik farkındalıklarının ve yetkinliklerinin artırılmasıdır. Finansal tüketicinin korunması ise finansal ürün ve hizmetleri arz edenler ile bunları talep edenler arasında hakkaniyetli ve adil bir alışveriş ortamını temin etmeye yönelik düzenlemeleri ifade etmektedir. Bu bağlamda talep yönünü “finansal okuryazarlık” arz yönünü ise “finansal erişim imkânları”nın oluşturduğu “finansal tabana yayılma” konusu önem kazanmaktadır. Finansal tabana yayılımın talep kısmını temsil eden finansal

okuryazarlığın ölçümü aşamasında ise finansal bilgi, finansal tavır ve finansal davranış etkenlerinin araştırılması gerekmektedir. Çalışmada TR90 Bölgesi'nde (Trabzon, Gümüşhane, Ordu, Artvin, Giresun, Rize) ikamet eden hane halkının finansal sağlık skorları belirlenmeye çalışılmıştır. Bu kapsamda bireylerin finansal bilgi, finansal tavır, finansal davranış, borç yönetimi, gelir, tasarruf düzeyi, bütçe ve finansal erişim parametreleri ayrı ayrı incelenmiştir.

Çalışmanın kısa ve uzun vadeli iki amacı bulunmaktadır. Çalışmanın kısa vadeli amacı, finansal sağlık endeksini belirleyen faktörleri belirleyerek, Türkiye için ortak bir FSE (Finansal Sağlık Endeksi) modeli oluşturmaktır. Çalışmanın uzun vadeli amacı ise, geliştirilen endeksin sürekli kullanımını sağlayarak, bireylerin finansal sağlık skorlarını online ölçebilecekleri bir süreci başlatmaktır. Yapılan ölçüm ve değerlendirmeler, gerek çalışmanın sonuçları gerekse ülke ekonomisi açısından önem arz etmektedir. Çalışma kapsamında belirlenen amaç ve hedefler ile bunların çıktıları, "Finansal Erişim, Finansal Eğitim, Finansal Tüketicinin Korunması Stratejisi ve Eylem Planları"na ilişkin 2014/10 sayılı Başbakanlık Genelgesi'nde istenen eylem planlarına hizmet etmektedir.

2. KAVRAMSAL ÇERÇEVE

2.1. Finansal Farkındalık

Finansal farkındalık genel olarak bireylerin finansal açıdan verecekleri kararlarda bilinçli hareket etmeleri ile ilgili bir kavramdır. Finansal açıdan yeterli bir donanıma sahip olabilmek ve yararlı bir finansal planlama yapabilmek için finansal kaynakların kullanımına ilişkin bilgi, beceri ve tutuma sahip olmak gerekmektedir (Eryılmaz, 2011: 2; Mayer vd., 2011: 175). Bireylerin finansal açıdan sağlıklı karar verebilmeleri için gerekli olan bilgi, beceri ve tutum kavramlarının bileşimi finansal farkındalığı ifade etmektedir. Finansal farkındalığa sahip bireyler finansal ürün ve hizmetler hakkında daha fazla bilgiye sahip, finansal risk ve fırsatları görebilen, daha sağlıklı tercihler yapabilen bireylerdir (Atkinson ve Messy, 2012: 10).

2.2. Finansal Okuryazarlık

Finansal okuryazarlığın birbirine benzer birçok tanımı yapılmıştır. Finansal okuryazarlık basit tanımıyla finansal bilgi düzeyini (Hilgert ve Hogart, 2003: 310) ifade etmektedir. Bugüne kadar yapılmış temel tanımlar incelendiğinde ise finansal okuryazarlık geniş olarak bireylerin gelirlerini, birikimlerini, harcamalarını, borçlarını, yatırımları ve bütçelerini yönetebilmek için kararlar alma yeteneği (Mandell 2007: 164; Lusardi ve Mitchell, 2007: 206) şeklinde tanımlanmıştır. Finansal okuryazarlık belirli bir döneme ait bilgi birikimi değil, çocukluktan emekliliğe kadar bireylerin finansal bilgi düzeyini ifade eden bir süreçtir. Bireylerin, finansal kararlar almadan önce temel finansal bilgileri

öğrenmeleri, verecekleri kararların çıktıkları ile ilişkilidir. Bu noktada bireyin ne kadar finansal okuryazar olduğu önem arz etmektedir.

Yapılan çalışmalar genel manada incelendiğinde bireylerin finansal okuryazarlık düzeylerinin düşük olduğu ve sahip oldukları finansal bilgileri kendilerine yeterli gördükleri ortaya çıkmaktadır. Birçok ülkede olduğu gibi Türkiye’de de finansal okuryazarlık farkındalığı ortaya koymak için kurumların faaliyetleri bulunmaktadır. Ancak birkaç özel teşebbüsün yanında sonuç verici çalışmalar yapılmamıştır.

2.3. Finansal Sağlık

Finansal sağlık konusu son zamanlarda ortaya çıkmış yeni bir kavramdır. Bu kavramın kabul görmüş bir tanımı bulunmamaktadır. Ancak yapılan araştırmalar özellikle artan tüketim harcamaları neticesinde bireylerin finansal sağlıklarını koruyabilmek için çaba gösterdiklerini ortaya koymaktadır. Finansal sağlık bir kavram olarak tanımlamadan önce bu kavrama ait bazı değişkenlerin ortaya koyulması gerekmektedir. Öncelikle bilinmesi gerek konu finansal sağlık sadece paranın olması veya olmaması ile ilgili bir kavram değildir. Diğer bir ifadeyle çok parası olan bir birey finansal açıdan sağlıklı, az parası olan bir birey finansal açıdan sağlıklı olabilir. Finansal sağlık daha çok paranın doğru yönetilmesi ile ilgili bir kavramdır. Buna göre finansal sağlığı *“bireylerin gelir düzeyleri, borç yönetim düzeyi, tasarruf eğilimleri, yatırım kararları ve finansal planlamaları sonucundaki mevcut ruh hali”* şeklinde tanımlayabiliriz. Bu tanımdan hareketle bireyler; zorunlu yaşam giderlerinden fazla gelir elde ediyorlarsa, finansal planlamasına doğru ilerliyorsa, tasarruf yapabiliyorsa, tasarrufunu yatırıma dönüştürebiliyorsa ve bu süreci yönetebiliyorsa finansal açıdan sağlıklı bir durumdadırlar. Tersisi durumda ise finansal sağlıkları kötü durumdadır.

Bireylerin finansal sağlığının iyi olabilmesi için kişisel finanslarını yönetebilecek düzeyde finansal bilgiye sahip olmaları gerekmektedir. Aksi takdirde gelir düzeyi çok yüksek olsa bile tasarruflar yanlış alanlarda değerlendiriliyorsa, finansal sağlık açısından olumsuz sonuçlar ortaya çıkabilecektir.

3. LİTERATÜR ÖZETİ

Bireylerin finansal sağlık skorlarının hesaplanması ile ilgili literatür incelendiğinde bu skorların tespitine yönelik doğrudan yapılan çalışmaların eksikliği literatürde bir boşluk olarak görülmektedir. Literatürde Türkiye’de en kapsamlı araştırma Boğaziçi Üniversitesi ve Türk Ekonomi Bankası işbirliğiyle İstanbul’da 2013 yılında başlatılmıştır. TEB 2013 yılından itibaren her yıl “Finansal Okuryazarlık ve Gelişim Endeksi Raporu”nu yayınlamaktadır. Bu çalışmanın ana temasını oluşturan “Bireylerde Finansal Farkındalık Yaratma” temelinden hareketle ilgili literatür incelendiğinde aşağıdaki çalışmalar tespit edilmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Literatürde Türkiye’de proje açısından en kapsamlı araştırma Boğaziçi Üniversitesi ve Türk Ekonomi Bankası işbirliğiyle İstanbul’da 2013 yılında başlatılmıştır. TEB 2013 yılından itibaren her yıl “Finansal Okuryazarlık ve Gelişim Endeksi Raporu”nu yayınlamaktadır.

Danes ve Hira (1987), Iowa State Üniversitesinde 323 öğrenci üzerinde yaptıkları çalışmada öğrencilerin finansal okuryazarlık düzeyini belirlemek için kredi kartı, sigorta, bireysel krediler gibi temel bilgileri test etmişlerdir. Araştırma sonucunda erkeklerin bayanlara oranla daha fazla bilgiye sahip oldukları ve finansal okuryazarlığın üst sınıflarda daha yüksek olduğunu tespit etmişlerdir. Markovich ve DeVaney (1997), 236 lisans öğrencisi üzerinde yaptıkları çalışmada öğrencilerin finansal bilgilerinin finansal davranışları üzerindeki etkisini tespit edememişlerdir. Ancak çalışmada erkek öğrencilerin bayan öğrencilere göre daha fazla finansal bilgiye sahip oldukları ortaya çıkmıştır. Chen ve Volpe (1998) 924 üniversite öğrencisi üzerine yapmış oldukları çalışmalarında işletme alanı dışında eğitim alanların, kadınların ve üniversitelerin ilk sınıflarındaki öğrencilerin finansal bilgi düzeylerinin daha düşük olduğunu tespit etmişlerdir. Beal ve Delpachitra (2003) Avusturyalı öğrencilerin finansal okuryazarlık seviyelerini ölçtükleri çalışmalarının sonuçlarına göre öğrencilerin finansal konulara yönelik yeterli seviyede bilgili ve becerikli olmadıklarını belirlenmiştir. Hogart (2002), ABD’deki yetişkinlerin finansal okuryazarlık durumunu 28 soruluk true/false testi ile belirlemeye çalışmıştır. Çalışma sonucunda daha düşük eğitilmiş ve daha düşük gelirli yetişkinlerin daha az finansal bilgiye sahip olduklarını tespit etmiştir. Chen ve Volpe (2002), çalışmalarında kişilerin finansal okuryazarlığını incelemek için 924 üniversite öğrencisine anket uygulamışlardır. Çalışma sonucunda finansal okuryazarlık konusunda kadınların genellikle daha az bilgiye sahip olduğu ve az bilgili öğrencilerin yanlış görüş, tutum ve yanlış kararlar eğiliminde oldukları tespit edilmiştir. Volpe ve diğ. (2002), çalışmalarında online yatırımcıların, yatırım okuryazarlık derecesini incelemişlerdir. Çalışmada, yatırımcıların yaş, eğitim, deneyim ve cinsiyetlerine göre farklı yatırım okuryazarlık derecelerine sahip olduklarını tespit etmişlerdir. Bunun yanında bayan yatırımcıların, erkek yatırımcılara göre daha az bilgiye sahip olduklarını belirlemişlerdir. Courchane ve Zorn (2005) çalışmalarında kişilerin finansal bilgi düzeyleri, tüketim davranışları ve kredi skorları arasındaki ilişkiyi incelemişlerdir. Araştırma sonuçlarına göre finansal bilgi düzeyi, finansal davranış ve kredi skorları birbirlerini pozitif yönde etkilemektedir. Worthington (2006), yetişkinlerin finansal okuryazarlığını belirlemek için logit regresyon modelini kullanmıştır. Çalışma sonunda finansal okuryazarlık çiftlik sahipleri, çalışanlar ve 50-60 yaş grubunda yüksek, çalışmayanlar, bayanlar ve İngilizce bilmeyenlerde düşük çıkmıştır. Lusardi ve Mitchell (2007), çalışmalarında bireylerin gelecek ile ilgili emeklilik planlamaları ve finansal okuryazarlık arasındaki ilişkiyi araştırmak için çalışma yapmışlardır. Çalışma sonucunda finansal okuryazarlığı yüksek olan kişilerin emeklilik planlamaları için yeterli bilgiye sahip oldukları tespit

edilmiştir. Gönen ve Özmete (2007) çalışmalarında bireylerin finansal yönetim ve finansal durumlarından duydukları tatmin, finansal davranışlar, kredi ve risk yönetim süreçleri ile öz saygı düzeylerini belirlemeyi amaçlamışlardır. Araştırmada Ankara'daki devlet üniversitelerinin çalışanlarına anket uygulanmış olup araştırma sonuçlarına göre bireylerin yaşam düzeyi, tasarruf edebilme, borçlarını ödeyebilme ve varlık düzeyi gibi finansal yönetim sürecine ilişkin birçok konudan duydukları tatmin derecesinin yüksek olmadığı tespit edilmiştir. Mandell ve Klein (2007) çalışmalarında motivasyon ile finansal okuryazarlık arasındaki ilişkiyi incelemiştir. Araştırma sonuçlarına göre motivasyonun finansal okuryazarlık düzeyi üzerinde anlamlı bir etkisinin olduğunu tespit etmişlerdir. Bireylerin uzun vadeli yatırım yapmaya yönelik sergilemiş oldukları olumsuz tutum veya kısa vadeli ihtiyaçlarının karşılanmasını önemsemelerinin, uzun süreli finansal planlamaya yönelimlerini engelleyeceği çalışmada ifade edilmiştir. Honohan (2008) 160 ülkenin verilerini incelediği çalışmada finansal bilgi ile finansal erişim arasında pozitif bir ilişkiyi tespit etmiştir. Analiz sonuçlarına göre düşük gelirli ülkelerde bireylerin finansal bilgilerinin zayıf olması finansal erişimi de olumsuz olarak etkilemektedir. Lusardi (2008), ABD'de farklı demografik özellikteki bireylerin finansal okuryazarlığını ölçmeye yönelik yaptığı çalışmada, Afro-amerikan, İspanyollar ve kadınların finansal okuryazarlığının düşük seviyelerde olduğunu tespit etmiştir. Bunun yanında, emeklilik, borsaya katılım eksikliği ve uygun olmayan koşullarda borçlanma davranışı, planlamada başarısızlık gibi tüm temel finansal kavramların eksik olmasında düşük eğitim seviyesinin etkili olabileceği ileri sürülmüştür. Cole, Sampson ve Zia (2008), Hindistan ve Endonezya'daki finansal okuryazarlık derecesini ölçtükleri çalışmada, finansal okuryazarlık ile finansal davranışlar arasında önemli bir ilişki olduğunu ve finansal okuryazarlığın hane halkının finansal davranışları açısından önemli olduğunu tespit etmişlerdir. Al-Tamimi ve Kalli (2009), yaptıkları çalışmada UAE'deki yatırımcıların finansal okuryazarlığının olması gereken düzeyden son derece düşük olduğunu belirlemişlerdir.

Mandell ve Klein (2009) 79 lise öğrencisinin finansal davranışlarına yönelik yapmış oldukları çalışmalarında kişisel finansal yönetim dersi alan öğrencilerin almayanlara nazaran daha iyi finansal davranış sergilediklerini ifade etmişlerdir. Lusardi, Mitchell, ve Curto, (2010) gençler üzerinde yapmış oldukları finansal bilgiye yönelik çalışmalarında yetişkinlerin büyük çoğunluğunun faiz, enflasyon ve risk gibi temel finansal konular hakkında bilgi sahibi olmadıklarını belirlemişlerdir. Pahnke ve Honekamp (2010), yaptıkları çalışmada Almanya'da yaşayan insanların, finansal okuryazarlığının özel emeklilik hükümleri üzerindeki etkileri incelenmiştir. Çalışma sonucunda ortalamının üstünde geliri olan hanelerin emeklilik planlaması yaptığı ve buna paralel olarak finansal okuryazarlığın emeklilik planlaması üzerinde de bir etkisinin olduğu tespit edilmiştir. Jorgensen ve Savla (2010), genç yetişkinlerin finansal okuryazarlığını ölçmeye yönelik yapmış oldukları çalışmada, genç yetişkinlerin

finansal okuryazarlığında ebeveynlerin etkisi araştırılmıştır 420 üniversite öğrencisi üzerinde yapılan anket sonuçlarına göre, finansal tutum üzerinde ebeveyn etkisinin orta düzeyde önemli bir etkisi olduğu ancak finansal bilgi üzerinde herhangi bir etkisi olmamaktadır. Robb ve Woodyard (2011) çalışmalarında bireylerin demografik özelliklerinin finansal davranış üzerindeki etkilerini incelemiştir. Araştırma sonuçlarına göre bireylerin yaş, eğitim ve gelir durumlarının finansal davranış üzerinde etkisi bulunmaktadır. Temizel ve Bayram (2011), çalışmalarında İktisadi ve İdari Bilimler öğrencilerinin temel düzeyde finansal okuryazarlık seviyesi belirlenmeye çalıştıkları çalışmalarında; öğrencilerin finansal durumlarını yönetmede kendilerini olduğundan daha başarılı olarak algıladıklarını ifade etmişlerdir.

Almenberg ve Soderbergh (2011) finansal okuryazarlık ve İsveçli yetişkinlerin emeklilik planlaması arasındaki ilişkiyi inceledikleri çalışmalarında, finansal okuryazarlık düzeyinin yaşlılar, kadınlar, düşük eğitimliler ve düşük gelirli olanlarda düşük çıktığı sonucuna ulaşmışlardır. Klapper ve Panos (2011) Rusya'da, finansal kriz döneminde düşük düzeydeki finansal okuryazarlığın etkilerini ortaya koymak için yaptıkları çalışmalarında; borçlanma oranlarının hızlı bir şekilde yükseldiği bir ortamda bile katılımcıların sadece %41'inin bileşik faiz kavramını bildiklerini, %46'sının enflasyonla ilgili basit bir soruyu cevaplayabildikleri görülmüştür. Duca ve Kumar (2014), ABD 'de hane halkları üzerinde yaptıkları çalışmalarında konut kredi kullanımı ve finansal okuryazarlık arasındaki ilişkiyi araştırmışlardır. Araştırma sonuçlarına göre finansal okuryazarlık düzeyi düşük hanelerin konut kredisinden vazgeçtiklerini tespit etmişlerdir. Ergün, Şahin ve Ergin (2014), çalışmalarında öğrencilerin finansal okuryazarlık düzeyleri ve finansal okuryazarlığın demografik özellikler ile ilişkili olup olmadığını anket yöntemi ile tespit etmeyi amaçlamışlardır. Çalışma sonuçlarına göre; öğrencilerin yalnızca temel düzeyde finansal okuryazar olduklarını belirlemişlerdir. Bunun yanında öğrencilerin temel enflasyon bilgilerinin cinsiyetlerine, öğretim şekillerine ve ortalama aylık hane gelirlerine göre; borsanın temel işlevi bilgilerinin cinsiyetlerine göre değiştiğini ifade etmişlerdir.

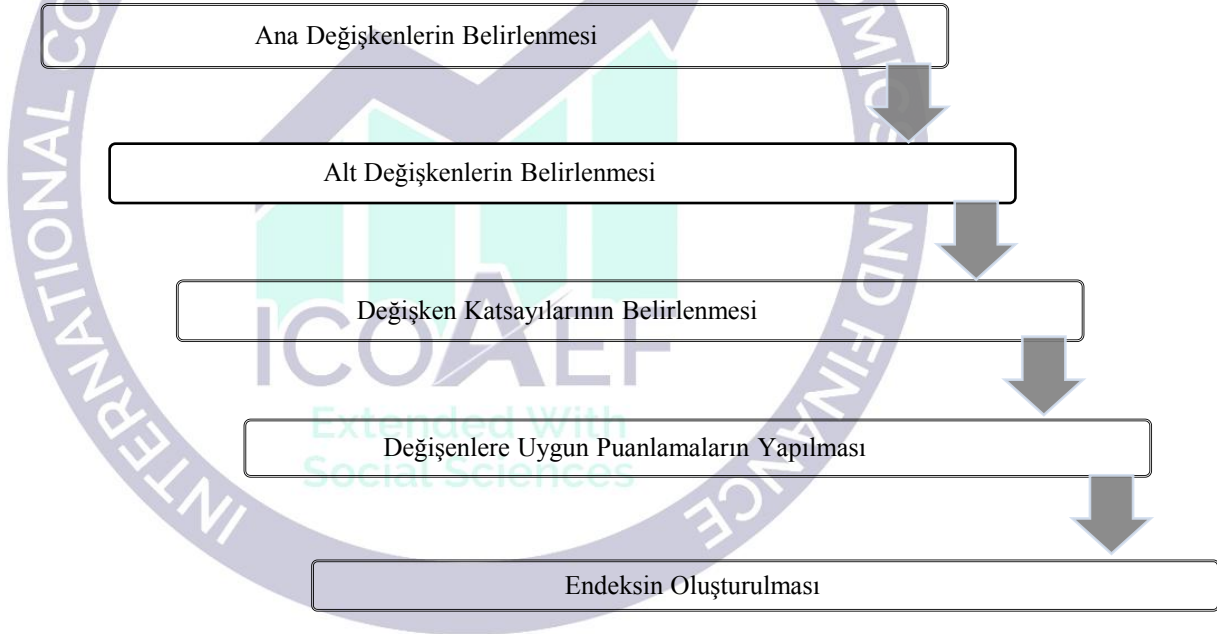
4. MATERYAL VE YÖNTEM

Araştırma kapsamında, gerekli bilgiler yüz yüze görüşme yapılarak anket yöntemi ile toplanmıştır. Çalışmada kullanılan ölçek olan anket formundaki sorular finansal eğitim konusunda öncü kuruluşlardan biri olan OECD nezdinde kurulan Finansal Eğitime Yönelik Uluslararası İşbirliği'nin (International Network on Financial Education, INFE) çeşitli ülkelerin farklı altyapılarına sahip insanların finansal okuryazarlık seviyelerini belirlemeye yönelik geliştirdiği ölçektir. Toplam 800 adet anket, anketörler tarafından bizzat soru cevap şeklinde mülakat olarak gerçekleştirilmiştir. Anketörlere, soruları nasıl yöneltecekleri, karşılaşılabilecekleri problemler ve çözümü konusunda ön eğitim

verilmiştir. Geri dönüşler sonucunda toplam 71 anket formu istenilen niteliklere uymadığı için değerlendirme kapsamı dışında bırakılmış ve toplam 729 anket formu analiz kapsamına alınmıştır. Belirlenen amaçlar çerçevesinde, demografik özelliklerinin tespitinin yanında finansal bilgi, finansal davranış, borç düzeyi, tasarruf düzeyi ve finansal tutum parametrelerine uygun değişkenler de analizde kullanılmıştır. Finansal sağlık skoru endeksinin belirlenebilmesi için öncelikle finansal sağlık skorunu endeksini oluşturulan değişkenler tespit edilmiştir.

Çalışmanın bulguları 2 ana gruba ayrılmıştır. Birinci grupta her bir değişkene ait tanımsal istatistiki bulgulara yer verilmiştir. İkinci grupta ise çalışmanın temel çıktısını oluşturan finansal sağlık skoru endeksine ait analizler yapılmıştır. Finansal sağlık skoru endeksinin oluşturulmasında takip edilen süreç aşağıda Şekil 1’de gösterilmiştir.

Şekil 1. Finansal Sağlık Skoru Endeks Oluşturma Süreci



Çalışma kapsamında finansal sağlık skorunun belirlenebilmesi ve endeksin oluşturulabilmesi için bireylerin gelir, bütçe uygulaması, finansal bilgi, finansal davranış, borç düzeyi, tasarruf düzeyi, finansal erişim düzeyi ve finansal tutumları ayrı ayrı değerlendirilip, puanlandırılmıştır. Elde edilen veriler çerçevesinde FSEM (Finansal Sağlık Endeksi Modeli) oluşturulmuştur. Buna göre FSEM aşağıdaki gibi modellenmiştir.

FSEM = β_1 Gelir Düzeyi + β_2 Bütçe Uygulamaları + β_3 Finansal Bilgi Düzeyi + β_4 Davranış Düzeyi +

$$\beta_5 \text{ Tutum Düzeyi} + \beta_6 \text{ Finansal Erişim Düzeyi} + \beta_7 \text{ Borç Düzeyi} + \beta_8 \text{ Tasarruf Düzeyi} \quad (1)$$

Model sonuçları her birey için 100 puan üzerinden dizayn edilmiş ve bireylerin finansal sağlık skorları 1 ile 100 puan arasında ortaya çıkarılmıştır. Ortaya çıkan puan düzeylerine göre puan aralıkları belirlenerek, bireylerin hangi gruba dâhil oldukları tespit edilmiştir. Finansal sağlık skoru modelinin oluşturulması için öncelikle endekse ait değişkenlerin belirlenmesi gerekmektedir. Bu sebeple ilgili ölçekten elde edilen değişkenler aşağıda detaylı olarak açıklanmıştır.

4.1. Gelir Düzeyi Alt Değişkenleri

Bireylerin gelir durumuna belirlenen alt değişkenler ve puanlama Tablo 1’de gösterilmiştir.

Tablo 1. Gelir Düzeyi Alt Değişken ve Puanlama Tablosu

| Gelir Düzeyi Değişkeni | Gelir Puanı |
|-------------------------------|--------------------|
| 0-1500 TL | 1 |
| 1501-2500 TL | 2 |
| 2501-3000 TL | 3 |
| 3001-4000 | 4 |
| 4001 TL ve üzeri | 5 |

Tablo’ 1 de görüldüğü gibi bireylerin gelir durumlarına göre sınıflandırılma yapılmış ve gelir düzeyi en düşük bireye “1” en yüksek bireye “5” puan olacak şekilde puanlandırma verilmiştir.

4.2. Bütçe Uygulama Değişkenleri

Bütçe uygulaması finansal planlama açısından önemli bir unsurdur. Düzenli olarak bütçe uygulayan ve bütçe kontrollü yapan bireylerin, harcama ve tasarruf konularında daha verimli sonuçlar elde edeceği düşünülmektedir. Bu sebeple bireylerden bütçe uygulayanlara “5”, uygulamayanlara “0” puan verilmiştir.

4.3. Finansal Bilgi Düzeyi

Bireylerin finansal bilgi düzeyini ölçmek ve puanlandırabilmek için Tablo 2’de gösterilen değişkenler ve puanlar kullanılmıştır.

Tablo 2. Finansal Bilgi Alt Değişken ve Puanlama Tablosu

| Finansal Bilgi Düzeyi Değişkeni | Bilgi Puanı |
|---|---------------------------------|
| Enflasyonun % 5 olduğu ortamda 1000 liranız ile birinci yılsonunda yapacaklarınız, bugün yapacaklarınızdan daha azdır | Doğru ise “5” Yanlış ise “0” |
| Bankadaki tasarruf hesabınıza 1000 TL yatırdınız ve yıllık net % 2 faiz garantisi aldınız. 5. Yılım sonunda bankadaki toplam paranız ne olur. | Doğru ise “5” Yanlış ise “0” |
| Yüksek getirili bir yatırımın, riski yüksektir. | Doğru ise “5” Yanlış ise “0” |

Tablo 2’de görüldüğü gibi finansal bilgi düzeyini ölçmek için 3 farklı değişken kullanılmıştır. Buradaki ifadelere doğru cevap verenlere “5”, yanlış cevap verenlere “0” puan verilmiştir.

4.4. Finansal Davranış Düzeyi

Bireylerin finansal davranış skorunu belirlemede kullanılan değişkenler ve puanlandırmaları Tablo 3’de sunulmuştur.

Tablo 3. Finansal Davranış Alt Değişken ve Puanlama Tablosu

| Finansal Davranış Düzeyi Değişkeni | Davranış Puanı |
|--|-----------------------|
| Faturalarımı zamanında öderim | 5-4-3-2-1 |
| Tasarruf ya da yatırım yaparken paramın bir kısmını riske atmaya hazırım. | 5-4-3-2-1 |
| Mali durumumu yakından takip ederim. | 5-4-3-2-1 |
| Uzun vadeli finansal hedefler belirler ve onlara ulaşmaya çalışırım. | 5-4-3-2-1 |
| Bir şey almadan önce maddi gücümün olup olmadığını dikkate alırım | 5-4-3-2-1 |
| Finansal durumum, benim için önemli olan şeyleri yapmada beni sınırlandırır. | 1-2-3-4-5 |
| Asgari yaşam giderlerimi ödemedi endişe duyuyorum. | 1-2-3-4-5 |

Tablo 3’de görüldüğü gibi finansal davranış düzeyine ilişkin 7 adet alt değişken belirlenmiştir. Bu değişkenlere ait likert ölçeğine göre hazırlanmış cevap şıklarından bireylerin vermiş olduğu cevaplara göre 1 ile 5 arasında puanlama yapılmıştır.

4.5. Finansal Tutum Düzeyi

Bireylerin finansal tutum skorunu belirlemede kullanılan değişkenler ve puanlandırmaları Tablo 4’de sunulmuştur.

Tablo 4. Finansal Tutum Alt Değişken ve Puanlama Tablosu

| Finansal Tutum Düzeyi Değişkeni | Tutum Puanı |
|--|-------------|
| Para harcamak içindir. | 1-2-3-4-5 |
| Bugün için yaşar, yarın için endişelenmem. | 1-2-3-4-5 |
| Parayı harcamak beni, uzun vadede tasarruf etmeden daha fazla tatmin eder. | 1-2-3-4-5 |

Tablo 4’de görüldüğü gibi finansal tutum düzeyine ilişkin 3 adet alt değişken belirlenmiştir. Bu değişkenlere ait likert ölçeğine göre hazırlanmış cevap şıklarından bireylerin vermiş olduğu cevaplara göre 1 ile 5 arasında puanlama yapılmıştır.

4.6. Finansal Erişim Düzeyi

Bireylerin finansal erişim skorunu belirlemede bireylerin sayılan finansal araçlara (kredi kartı, hisse senedi, tasarruf hesabı, emeklilik fonu, tahvil, zorunlu olmayan sigorta vb.) sahip olma durumuna göre puanlandırma yapılmıştır. Buna göre bireylerden bu finansal araçlardan en az birine sahip olana “5”, hiç olmayanlara “0” puan verilmiştir.

4.7. Tasarruf Düzeyi

Bireylerin tasarruf skorunu belirlemede kullanılan değişkenler ve puanlandırmaları Tablo 5’de sunulmuştur.

Tablo 5. Tasarruf Düzeyi Alt Değişken ve Puanlama Tablosu

| Tasarruf Düzeyi Değişkeni | Tasarruf Puanı |
|--|------------------------------|
| Bazen insanlar gelirlerinin, asgari geçim giderlerini karşılamayacağını düşünürler. Son 1 yılda hiç böyle düşündünüz mü? | Düşünmedi “5” Düşündü “0” |
| Son 1 yılda para tasarrufu yaptınız mı? | Yaptı “5” Yapmadı “0” |

Tablo 5’de görüldüğü gibi bireylerin tasarruf düzeyine ilişkin 2 adet alt değişken belirlenmiştir. Bu iki değişken için asgari geçiminden endişe duymayanlar ile para tasarrufunda bulunanlara “5” puan verilmiştir.

4.8. Borç Düzeyi

Bireylerin borç düzeyini belirlemede kullanılan değişkenler ve puanlandırmaları Tablo 6’da sunulmuştur.

Tablo 6. Borç Düzeyi Alt Değişken ve Puanlama Tablosu

| Borç Düzeyi Değişkeni | Borç Puanı |
|---------------------------------------|-------------------|
| Şu anda çok fazla borcum var. | 1-2-3-4-5 |
| Şu anki finansal durumumdan memnunum. | 5-4-3-2-1 |

Tablo 6'da görüldüğü gibi bireylerin borç düzeyine ilişkin 2 adet alt değişken belirlenmiştir. Bu iki değişkene ait likert ölçeğine göre hazırlanmış cevap şıklarından bireylerin vermiş olduğu cevaplara göre 1 ile 5 arasında puanlama yapılmıştır.

İlgili endeks için tüm değişkenler için elde edilecek minimum ve maksimum puanlar Tablo 7'de gösterilmiştir.

Tablo 7. Endeks Temel Değişkenlere Ait Minimum ve Maksimum Puanlar

| Ana Değişkenler | Minimum Puan | Maksimum Puan |
|--------------------------|---------------------|----------------------|
| Gelir Düzeyi | 1 | 5 |
| Bütçe Uyguma Düzeyi | 0 | 5 |
| Finansal Bilgi Düzeyi | 0 | 15 |
| Finansal Davranış Düzeyi | 7 | 35 |
| Finansal Tutum Düzeyi | 3 | 15 |
| Finansal Erişim Düzeyi | 0 | 5 |
| Tasarruf Düzeyi | 0 | 10 |
| Borç Düzeyi | 2 | 10 |
| TOPLAM PUAN | 13 | 100 |

5. BULGULAR

5.1. Demografik Bulgular

Araştırma kapsamındaki bireylere ait demografik bulgular Tablo 8'de gösterilmiştir.

Tablo 8. Bireylerin Demografik Dağılımları

| Cinsiyet | Frekans | Yüzde | Meslek | Frekans | Yüzde |
|------------------|---------|-------|----------------|---------|-------|
| Bay | 457 | 62,7 | Esnaf | 165 | 22,6 |
| Bayan | 272 | 37,3 | Memur | 130 | 17,8 |
| Toplam | 729 | 100,0 | İşçi | 187 | 25,7 |
| Eğitim Düzeyi | Frekans | Yüzde | Serbest Meslek | 53 | 7,3 |
| Lisansüstü | 43 | 5,9 | Emekli | 24 | 3,3 |
| Lisans | 259 | 35,5 | Çiftçi | 14 | 1,9 |
| Lise | 288 | 39,5 | Diğer | 156 | 21,4 |
| Ortaokul | 81 | 11,1 | Toplam | 729 | 100,0 |
| İlkokul | 51 | 7,0 | İkamet | Frekans | Yüzde |
| Eğitim Almamış | 7 | 1,0 | Trabzon | 131 | 18,0 |
| Toplam | 729 | 100,0 | Gümüşhane | 111 | 15,2 |
| Gelir Düzeyi | Frekans | Yüzde | Artvin | 108 | 14,8 |
| KBMG Altında | 410 | 56,2 | Ordu | 138 | 18,9 |
| KBMG Seviyesinde | 158 | 21,7 | Rize | 118 | 16,2 |
| KBMG Üstünde | 161 | 22,1 | Giresun | 123 | 16,9 |
| Toplam | 729 | 100,0 | Toplam | 729 | 100,0 |

KBMG: Kişi Başı Milli Gelir

Tablo 8’de görüldüğü gibi araştırma kapsamındaki bireylerin % 62,7’si bay, % 37,3’ü ise bayandır. Bu bireylerin % 39,5’i lise, % 41,4’ü ise lisans ve lisansüstü eğitime sahiptir. Araştırma kapsamındaki bireylerin % 56,2 oranla büyük bir kısmının gelir düzeyi KBMG seviyesinin altında yer almaktadır. Bireylerin yüzde 25,7’si işçi, yüzde 22,6’sı esnaf, % 17,8’i ise memurdur. Bu üç mesleğin toplam meslek dağılımı içerisindeki payı yaklaşık % 66’dır.

5.2 Finansal Sağlık Skoru Model Bulguları

Finansal sağlık skorunun belirlenebilmesi ve endeksin oluşturulabilmesi için bireylerin gelir, bütçe uygulaması, finansal bilgi, finansal davranış, borç düzeyi, tasarruf düzeyi, finansal erişim düzeyi ve finansal tutumları ayrı ayrı değerlendirilip, puanlandırılmıştır. Bu aşamada öncelikle her bir değişken için ilgili katsayı hesaplaması yapılmıştır. Buna göre değişkenlere ait katsayıların hesaplaması aşağıdaki Tablo 9’da gösterilmiştir.

Tablo 9. Değişken Katsayılarının Hesaplanması

| Ana Değişkenler | Toplam İçindeki Payı (%) | İstenilen Puan Ağırlığı (%) | Katsayı |
|--------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------|
| Gelir Düzeyi | 5 | 12,5 | 2,5 |
| Bütçe Uyguma Düzeyi | 5 | 12,5 | 2,5 |
| Finansal Bilgi Düzeyi | 15 | 12,5 | 0,833 |
| Finansal Davranış Düzeyi | 35 | 12,5 | 0,3571 |
| Finansal Tutum Düzeyi | 15 | 12,5 | 0,833 |
| Finansal Erişim Düzeyi | 5 | 12,5 | 2,5 |
| Tasarruf Düzeyi | 10 | 12,5 | 1,25 |
| Borç Düzeyi | 10 | 12,5 | 1,25 |
| TOPLAM | 100 | 100 | |

Tablo 9’da görüldüğü gibi 8 adet değişkenin toplam içindeki paylarının eşit olması için toplam içindeki ağırlık değerleri, yüzdesel aritmetik ortalama değerleri ile oranlanarak katsayılar belirlenmiştir. 8 adet değişkenin toplam endeks puanı içindeki ağırlığı (100/8) 12,5 puan olarak belirlenmiştir. Daha sonra değişkenler için istenilen puan ağırlığı mevcut ağırlık puanına bölünerek katsayı hesaplanmıştır. Bu işlem sonucunda tüm değişkenlerin toplam endeks puanı üzerindeki payının eşit olması sağlanmıştır. Belirlenen katsayılara göre model aşağıdaki gibi oluşturulmuştur.

FSEM = 2,5 Gelir Düzeyi + 2,5 Bütçe Uygulamaları + 0,833 Finansal Bilgi Düzeyi + 0,3571 Finansal Davranış Düzeyi + 0,833 Finansal Tutum Düzeyi + 2,5 Finansal Erişim Düzeyi + 1,25 Borç Düzeyi + 1,25 Tasarruf Düzeyi

Elde edilen modelin çalıştırılması ile çalışma kapsamındaki bireylerin endeks puanları Tablo 10’da gösterilmiştir.

Tablo 10. Finansal Sağlık Endeksi Model Sonuçları

| Gözlem Sayısı | Minimum Puan | Maksimum Puan | Ortalama Puan | Standart Sapma |
|---------------|--------------|---------------|---------------|----------------|
| 729 | 27,85473 | 93,20915 | 61,81675 | 12,57342 |

Tablo 10’da görüldüğü gibi araştırma kapsamındaki bireylerin ortalama endeks puanı 61,81675 olarak hesaplanmıştır. En düşük bireyin aldığı puan 27,85473 iken en yüksek skora sahip bireyin puanı ise 93,20915 olarak hesaplanmıştır. Genel olarak değerlendirildiğinde TR90 bölgesindeki bireylerin

finansal sağlık skorları ortalama düzeydedir. Bireylerin hesaplanan endeks değerlerine göre belirlenen aralıklar ise Tablo 11’de sunulmuştur.

Tablo 11. Finansal Sağlık Endeksi Aralık Tablosu

| | Çok Düşük Düzey | Düşük Düzey | Orta Düzey | Yüksek Düzey | Çok Yüksek Düzey |
|----------------|------------------------|--------------------|-------------------|---------------------|-------------------------|
| Frekans | 18 | 193 | 401 | 101 | 16 |
| Yüzde | 0,025 | 0,265 | 0,55 | 0,138 | 0,022 |

Tablo 11’de modelin çalıştırılması sonucu oluşan endeks puanlarının bireylere göre dağılımı sunulmuştur. Buna göre bireylerin puan aralıkları ağırlıklı olarak orta düzeydedir. Çok yüksek finansal sağlık skoruna sahip bireylerin oranı % 2,2 iken, çok düşük düzeyde sağlık skoruna sahip bireylerin oranı % 2,5’dir. Araştırma kapsamındaki bireylerin ağırlıklı olarak oranı yüzde 55 ile orta düzeydedir.

6. TARTIŞMA VE SONUÇ

“Finansal Erişim, Finansal Eğitim, Finansal Tüketicinin Korunması Stratejisi ve Eylem Planları’na ilişkin 2014/10 sayılı Başbakanlık Genelgesi 5 Haziran 2014 tarihli ve 29021 sayılı Resmi Gazete’de yayımlanmıştır. Genelgedeki, “Finansal Tabana Yayılma 3 Nolu Eylem Planı’na göre “Türkiye’deki Finansal Okuryazarlık Düzeyinin İzlenmesine Yönelik Anket Çalışmaları Yapılması, Mevcut Anket Çalışmalarının Değerlendirilmesi” istenmektedir. Bu açıdan çalışma ilgili genelge ile doğrudan ilişkilidir. Çalışmada, finansal farkındalık çerçevesinde TR90 Bölgesi’ndeki (Trabzon, Gümüşhane, Ordu, Artvin, Giresun, Rize) bireylerden elde edilen veriler kullanılarak finansal sağlık endeksi modeli oluşturulması amaçlanmıştır. Bu bağlamda öncelikle OECD tarafından geliştirilen ölçek yardımıyla bireylerden veriler elde edilmiştir. Elde edilen veriler iki grupta analize tabi tutulmuştur. Bunlar demografik bulgular ve finansal sağlık endeksi bulgularıdır. Çalışmaya kapsamında toplam 729 bireye ait veriler incelenmiştir. % 62,7 si erkek, % 52,9’u evli, yaklaşık % 46’sı lisans ve lisansüstü diplomaya sahip bu bireylerin % 56,2 si kişi başı milli gelir seviyesinin altında gelir elde etmektedir.

Çalışmada kullanılan ölçekten toplam 8 ana değişken belirlenmiş ve finansal sağlık endeksi modeli bu değişkenler çerçevesinde oluşturulmuştur. Bu değişkenler; bireylerin finansal bilgileri, finansal tavırları, finansal davranışları, borç düzeyleri, gelirleri, tasarruf düzeyleri, bütçe uygulamaları ve finansal erişim düzeyleridir. Bu değişkenlerin endeks içindeki paylarının eşit olması için toplam içindeki ağırlık değerleri, yüzdesel aritmetik ortalama değerleri ile oranlanarak katsayılar belirlenmiştir. 8 adet değişkenin toplam endeks puanı içindeki ağırlığı (100/8) 12,5 puan olarak belirlenmiştir. Daha sonra değişkenler için istenilen puan ağırlığı mevcut ağırlık puanına bölünerek değişkenlerin katsayıları hesaplanmıştır. 8 ana değişkenden ve 20 alt değişkenden oluşan bir endeks elde edilmiştir. Bu endeks

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

modelinde bir birey en düşük 13 puan en fazla 100 puan alabilmektedir. Ortaya koyulan endeks modelinin çalıştırılması ile bireylerin ortalama finansal sağlık endeksi puanının 61,81675 olduğu tespit edilmiştir. Elde edilen bu puan ortalamasının biraz üzerindedir. Çalışmada ayrıca bireyler aldıkları puanlara göre sınıflandırılmaya tabi tutulmuştur. Bu sınıflandırmaya göre çok düşük düzeyde, düşük düzeyde ve orta düzeyde puana sahip bireylerin temel finansal bir altyapı eğitimine ihtiyaçları olduğunu söyleyebiliriz. Yüksek düzeyde puana sahip bireylere de ileri düzey finansal eğitim verilmesi gerekmektedir.

Geliştirilen bu yeni finansal sağlık endeksi özellikle bireylerin mevcut durumlarının tespiti ve alınacak önlemler açısından büyük önem arz etmektedir. Bu endeks yardımı ile bireyler, finansal durumları hakkında güncel bilgilere sahip olacaklardır. Bireylerde finansal farkındalık meydana gelecek ve finansal eğitimlerine daha fazla önem vermeye başlayacaklardır. Bireylerin finansal farkındalığının artması ulusal ekonomiler açısından çok önemlidir. Zira finansal farkındalığı artan bireylerin tasarruf miktarlarını arttırması, bilinçli yatırım kararları alması ve finansal hedeflerine ulaşmada etkili yollar bulması beklenmektedir. FSEM ayrıca, finansal sağlık endeksi puanlarına göre iller ve bölgeler bazında veriler tespit edilerek, planlanan finansal eğitimlerin altyapısını oluşturmada bir gösterge olarak kullanılabilir. Bu endeks, mevcut haliyle veya geliştirilerek bilimsel araştırma ve yayınlarda ortak bir ölçüm aracı olarak kullanılabilir.

KAYNAKÇA

- Almenberg, J. ve Save-Soderberg J. (2011) "Financial Literacy and Retirement Planning in Sweden", Network for Studies on Pensions, Ageing and Retirement Discussion Papers 112: 1-28.
- Al-Tamimi, H.A.H. ve Bin Kalli, A.A. (2009) "Financial Literacy and Investment Decisions of UAE Investors", Journal of Risk Finance, 10(5); 500-516.
- Atkinson, A. ve Messy, F.A. (2012) "Results of the OECD/ International Network on Financial Education (INFE) Pilot Study", OECD Working Papers on Finance, Insurance and Private Pensions, 15: 1-72.
- Beal, D.J. ve Delpachitra, S.B. (2003) "Financial Literacy Among Australian University Students", Economic Papers, 22(1): 65-78.
- Chen, H. ve Volpe, R.P. (1998) "An Analysis of Personal Financial Literacy Among College Students", Financial Services Review, 7(2): 107-128.
- Chen, H. ve Volpe, R.P. (2002) "Gender Differences in Personal Financial Literacy Among College Students", Financial Services Review, 11(3): 289-307.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Cole, S., Sampson, T. ve Zia, B. (2008) "Money or Knowledge? What Drives The Demand for Financial Services in Developing Countries?", Harvard Business School Working Paper, 09-117: 1-51.
- Courchane, M.J. ve Zorn, P.M. (2005) "Consumer Literacy and Credit Worthiness", http://www.chicagofed.org/digital_assets/others/events/2005/promises_and_pitfalls/paper_literacy.pdf, (09.11.2017).
- Danes, S. M. ve Hira, T.K. (1987) "Money Management Knowledge of College Students" The Journal of Student Financial Aid, 17: 4-16.
- Duca, J. ve Kumar, A. (2014) "Financial Literacy and Mortgage Equity Withdrawals" Journal of Urban Economics, 80: 62-75.
- Ergün, B., Şahin, A. ve Ergin, E. (2014) Ergin, E. "Finansal Okuryazarlık: İşletme Bölümü Öğrencileri Üzerine Bir Çalışma", The Journal of International Social Research, 7(34): 847-863.
- Eryılmaz, A. (2011) "Pozitif Psikoterapi ve Gelişimsel Rehberlik Bağlamında Ergenler İçin Bütçe Yönetme Konusunda Sınıf Rehberliği Programı", Eğitim Bilimleri Araştırmaları Dergisi Uluslararası E-Dergi, 1 (1): 1-17.
- Gönen, E. ve Özmete, E. (2007) "Finansal Refah: Finansal Yönetim Sürecinden Duyulan Tatmin, Finansal Davranışlar İle Öz-saygı Arasındaki İlişkinin İncelenmesi", Aile ve Toplum, 9(3): 57-69.
- Hilgerth, M.A, Hogarth, J.M. ve Beverly, S.G. (2003) "Household Financial Management: The Connection between Knowledge and Behavior", Federal Reserve Bulletin, 89(7): 309-322.
- Hogarth, J.M. (2002) "Financial Literacy and Family and Consumer Sciences. Journal of Family and Consumer Sciences. 94: 15-28.
- Honohan, P. (2008) "Cross-Country Variation in Household Access to Financial Services", Journal of Banking & Finance, 32(11): 2493-2500.
- Jorgensen, B. L. ve Savla, J. (2010) "Financial Literacy of Young Adults: The Importance of Parental Socialization", Interdisciplinary Journal of Applied Family Studies, 59(4): 341-393.
- Klapper, L. ve Panos, G.A. (2011) "Financial Literacy and Retirement Planning: the Russian Case", Journal of Pension Economics and Finance 40(4): 599-618.
- Lusardi, A. (2008). "Household Saving Behavior: The Role of Financial Literacy, Information, and Financial Education Programs", NBER Working Paper Series, Working Paper 13824.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Lusardi, A. ve Mitchell, O.S. (2007) “Baby Boomer Retirement Security: The Roles of Planning”, Financial Literacy, and Housing Wealth. *Journal of Monetary Economics*, 54: 205-224.
- Lusardi, A., Mitchell, Olivia S. ve Curto, V. (2010) “Financial Literacy Among The Young”, *Journal of Consumer Affairs*, 44(2): 358-380.
- Mandell, L. (2007) “Financial Literacy of High School Students, Ed: Xiao J.J. *Handbook of Consumer Finance Research*, New York, Springer.
- Mandell, L. ve Klein, L. S. (2009) “The Impact of Financial Literacy Education on Subsequent Financial Behavior”, *Journal of Financial Counseling and Planning*, 20(1): 15-24.
- Mandell, L. ve Klein, L.S. (2007). “Motivation and Financial Literacy”, *Financial Services Review*, 16: 105-116.
- Markovich, C.A. ve DeVaney, S.A. (1997), “College Seniors' Personal Finance Knowledge and Practices”, *Journal of Family and Consumer Sciences*, 89: 21-28.
- Mayer, R.N., Zick, C.D. ve Marsden, M. (2011). “Does Calculating Retirement Needs Boost Retirement Savings?”, *The Journal of Consumer Affairs*, 45(2): 175–200.
- Pahnke, L. ve Honekamp, I. (2010) “Different Effects of Financial Literacy and Financial Education in Germany, (Graduate Thesis), University of Bamberg, Chair in Economics, Especially Empirical Microeconomics.
- Robb, C. ve Woodyard, A., S. (2011) “Financial Knowledge and Best Practice Behavior”, *Journal of Counseling and Planning*, 22(1): 60-70.
- Temizel, F. ve Bayram, F. (2011) “Finansal Okuryazarlık: Anadolu Üniversitesi İktisadi İdari Bilimler Fakültesi (İİBF) Öğrencilerine Yönelik Bir Araştırma”, *Cumhuriyet Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi*, 12(1): 73-86.
- Volpe, R. P., Chen, H. ve Liu, S. (2006) “An Analysis of the Importance of Personal Finance Topics and the Level of Knowledge Possessed by Working Adults”, *Financial Services Review*, 15(1): 81–99.
- Worthington, A.C. (2006) “Predicting Financial Literacy in Australia”, *Financial Services Review*, 15(1): 59-79.

THE ORIGIN OF FLUCTUATIONS IN MACROECONOMIC INDICATORS IN ALGERIA

Dr. Dahmani Mohamed DRIOUCHE*

Attouchi MANEL**

ABSTRACT

The aim of this study is to examine the origin of fluctuations in macroeconomic variables in Algeria, using time series data over the extended period from 1990 to 2016. The results of principal components analysis indicate that the years from 2002 to 2007 are characterized by an increase in RGDP, exchange rate and exports, this rise due to the improvement of the Algerian economy which hails from the evolution of oil prices, as well as the evolution of the unemployment rate was because of oil prices which have decreased between 1996 and 2000. So changes in the indicators of economic growth are caused by fluctuations in oil prices. And the Granger causality test proves that oil prices cause CPI, exports and unemployment rate. In this case, Algeria must activate the policies of economic diversification and structural transformation to be independent of hydrocarbons, in addition it has to create a sustainable and high growth rates.

Keywords: *Macroeconomic Indicators, Oil Prices, Algeria, PCA.*

JEL Classification: *O11, E10, E30.*

1.INTRODUCTION

The fluctuations of oil price in the 1970s generated abundant literature on the effect of oil price shocks on economic performance in oil importing and exporting countries (Brown and Yücel, 2002). The Dutch disease model (Corden and Neary, 1982) proposed a theoretical framework to explain the transmission mechanism of the impacts of an oil price boom on the economic activity in oil-exporting country.

However, oil is the main driver of economic growth in most oil-exporting countries and, therefore, oil prices have a dramatic effect on their macroeconomic plan. Oil revenues can indeed contribute to develop those countries. While, high oil revenues encourage those economic conditions that stifle

* Djilali Liabes University, Sidi Belabes, Algeria, dah9moh@yahoo.fr

** Djilali Liabes University, Sidi Belabes, Algeria, attouchimanel@gmail.com

growth, for instance : appreciation of exchange rate, rising prices (inflation), and rent-seeking. This effect of oil price falls is clearly reflected in the empirical literature (Saeed Moshiri 2013).

Looking to detect the type of relationship between crude oil price and economic activity (performance) is considered as a significant study for both investors ; to take necessary investment decisions, and for policy makers ; in order to regulate financial markets more effectively (Erdoğan et al., 2016) .

Algeria has relied heavily on hydrocarbon export earnings, particularly oil revenues, to achieve some of its development goals, during years when oil prices peaked in oil markets. However, any fluctuation in oil prices will inevitably have an impact on the Algerian macroeconomic variables (BOUDIA et al, 2017) . During the last decade, hydrocarbon revenues have been used to finance the various economic recovery programs and to significantly reduce the country's external debt. Gross domestic product (GDP) thus remains strongly influenced by production behavior in the hydrocarbon sector, given the weight of this sector in GDP formation (hydrocarbon sector contributed on GDP by 52% in 2007). The destabilizing effect of a decline in the price of crude oil is therefore evident. This impact is widely visible in the foreign trade statistics of Algeria during the year 2009. According to the National Center for Informatics and Statistics (CNIS) of Algerian Customs, exports reached 35.97 billion dollars during the first ten months of 2009, compared to 68.03 billion in the same period last year (2008), a decrease of 47.13%. As for imports, they reached 32.60 billion dollars at the end of October 2009 compared with 32.52 at the same period in 2008. This fall in the value of exports was reflected in the surplus of the trade balance which is from \$ 35.5 billion in the first ten months of 2008 to only \$ 3.3 billion in the same period of 2009.

As the economic development of Algeria is mainly due to the supply revenue of natural resources from hydrocarbons, we will try through this paper to answer the following question: *How do oil prices affect Algerian macroeconomic indicators?*

The objective of this paper is to investigate the co-movement of oil prices and the macroeconomic index by Principal Component Analysis (PCA). Then, we will test if oil prices have a causality relationship among our variables .

2.LITERATURE REVIEW

Hamdi and Sbia (2013) examine the dynamic relationships between oil revenues, government spending and economic growth in the Kingdom of Bahrain, using a multivariate cointegration analysis and error-correction model and data for 1960–2010. Overall results suggest that oil revenues remain the

principal source of economic growth and the main channel which finance the government spending in the country.

Khalid Ahmed , Niaz Ahmed Bhutto and Muhammad Ramzan Kalhoro (2018) study the impact of oil price on : real GDP, interest rate, inflation and exchange rate, for five SAARC countries (i.e., India, Pakistan, Bangladesh, Sri Lanka and Bhutan) from 1982 to 2014 , Johansen (1991) cointegration method is applied for long-run relationship. The results of cointegration test confirms the long-run equilibrium relationship between all the underlying variables, it is also revealed that shocks of oil price affect the output, interest rate, inflation and exchange rate in five SAARC nations in short run except inflation and exchange rate in Bangladesh and Sri Lanka respectively.

Cogni and Manera (2008) selected Canada, France, Germany, Italy, Japan, the United Kingdom, and the United States to deduct the causality analysis and they found bidirectional causality between oil price and overall economic activity for the majority of countries. The aim of this study was to examine the direct effects of oil price shocks on output and prices, and the reaction of monetary variables to external shocks.

Abdoulkarim Esmaili and Zainab Shokoohi (2010) investigate the co-movement of food prices and oil price by principal component analysis (PCA) to further understand the influence of the macroeconomic index (crude oil prices, consumer price indexes, food production indexes and GDP) on food prices, for the period 1961- 2005, using the Scree test and the proportion of variance method for determining the optimal number of common factors. The results of the Granger causality test demonstrate that the food production index has the greatest impact on the macroeconomic indicators and the oil price index affects the food production index. Consequently, crude oil prices have an indirect effect on food prices.

Cunado and De Gracia (2005) analyze the relationship between oil price and the macroeconomic indicators of sixth Asian countries (i.e., Japan, Thailand, Malaysia, South Korea, Philippines, and Singapore) over the period 1975Q1-2002Q2. The results suggest that oil prices have a significant effect on both economic activity and price indexes in the long-run. However, they further explained that in short run, the effect varies mostly depending on whether the country is net oil importer or net oil exporter, therefore this impact is limited at the short term and more significant when oil price shocks are defined in local currencies.

Nagmi M. Mofteh Aimer (2016) investigates the impact of fluctuations in oil prices on Libya's economic growth, by using the VAR modal and co-integration techniques from 2000 to 2015. The results indicate that there is a long-term relationship between crude oil price and growth. The estimates

suggest that higher oil price has a positive and statistically important impact on the economic growth of Libya.

Ayşen, E. and M. Mehmet, (2014), aim to examine the effects of oil prices on Turkish economic growth by using annual data between the years 1980-2013. For analyzing variables, it has been used Johansen Cointegration Test, Impulse-Response Function, and Variance Decomposition tests. The results indicate that there is no long-term relationship between the variables. That a shocks in oil price have a negative effect on gross domestic product at the short term.

Ftiti et al. (2016) examine the degree of interdependence between oil prices and economic activity growth for: United Arab Emirates, Kuwait, Saudi Arabia, and Venezuela, over the period from 3 September 2000 to 3 December 2010. They use the cointegration methodology developed by Engle and Granger (1987). The results show that at the short and medium run, oil price shocks during the period of fluctuations in the global business cycle and/or financial turmoil affect the economic growth in OPEC countries, while the effect of the medium-term is greater than the short one.

Negi (2015) examines the impact of oil price on GDP of the four largest fast growing emerging economies Brazil, Russia, India and China from 1987 to 2014. The results show that an increase in oil prices has a negative relationship with gross domestic product in China and India and on the other side in Russia and Brazil the evolution of oil price has a positive effect on GDP.

Al Rasasi, M. and M. Yilmaz, 2016 study the effect of oil price volatility on Turkish economic growth, using quarterly data from 1987:Q2 to 2015:Q1, the authors select the following macroeconomic aggregates : real (GDP), nominal exchange rates (national currency per US dollar), (CPI), and crude oil price. Test results of both Trace and eigenvalue tests of Johansen and Juselius (1990) suggest the existence of three cointegration relationships between the variables. They find that oil price shocks affect output growth negatively. Although, an increase in oil prices is associated with a higher inflation, and depreciating of exchange rate.

3.RESULTS AND DISCUSSION

We took the macroeconomic variables : Rate of GDP, Consumer Price Index (CPI) , exchange rate, unemployment rate ; exports and imports, for the period 1990–2016 from the World Bank except exchange rate data are taken from the national statistics office . And oil price data is collected from database of the OPEC .

3.1. Principal Component Analysis

We will apply the method of analysis in principal components, it aims at the description, the visualization of the information contained in tables of quantitative data. We will make a reference change in IR^6 so as to be placed in a new system of representation (IR^2) where the first axis brings as much as possible of the total inertia of the cloud, the second axis the most possible inertia not taken into account by the first axis, and so on.

The aim is to study the link between the indicators of economic growth and the analysis of the coordinates of individuals, that is to say, the distribution of years relative to each other.

3.1.1. Correlation Matrix

The correlation matrix makes it possible to take stock of the linear links between the variables, it detects the correlations that exist between our variables.

Table 1. Correlation matrix for macroeconomic index

| Variables | RGDP | CPI | Exchange rate | Unemployment rate | Imports | Exports |
|-------------------|---------|---------|---------------|-------------------|---------|---------|
| RGDP | 1 | -0,5406 | 0,6574 | -0,0106 | 0,0634 | 0,3688 |
| CPI | -0,5406 | 1 | -0,7817 | 0,2758 | -0,0889 | -0,6258 |
| Exchange rate | 0,6574 | -0,7817 | 1 | -0,3795 | 0,3283 | 0,5247 |
| Unemployment rate | -0,0106 | 0,2758 | -0,3795 | 1 | -0,7182 | -0,4368 |
| Imports | 0,0634 | -0,0889 | 0,3283 | -0,7182 | 1 | 0,0468 |
| Exports | 0,3688 | -0,6258 | 0,5247 | -0,4368 | 0,0468 | 1 |

From the correlation matrix we found that: the RGDP variable is moderately and positively correlated with the exchange rate variable 0.6574, it is moderately and negatively correlated with the CPI which is significant -0.54 because there is an indirect relationship between GDP and inflation, if the GDP is in his lower level, the revenues cannot be highest, in this case CPI will increase and it leads to a decrease in purchasing power.

- The CPI is strongly and negatively correlated with exchange rate (-0.78) which is a no significant in the case of Algeria. Because, the Algerian exchange rate is usually appreciated so this is a reason of domestic inflation (a high price of consumer goods) , which is a symptom of Dutch disease.

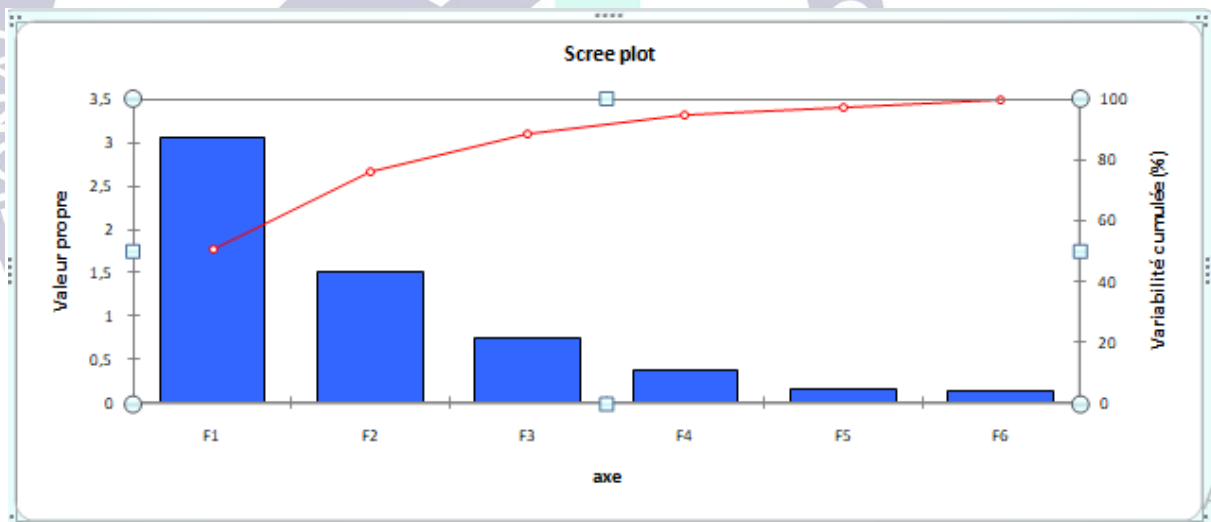
- The exchange rate variable is moderately and positively correlated with the export, a surplus of the balance of payments has a positive effect on the value of the currency, because the foreign currency is converted into national currency to buy goods and services, increasing thus the demand for the local currency. In Algeria a high exports of oil cause an appreciation of the domestic currency , so it increases compared with the foreign devise.

3.1.2. Study Of The Eigenvalues:

Table 2. Eigenvalues and Variability of Factors

| Number of factors | F1 | F2 | F3 | F4 | F5 | F6 |
|--------------------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|
| Eigenvalues | 3,0497 | 1,5226 | 0,7566 | 0,3725 | 0,1534 | 0,1453 |
| Variability (%) | 50,8277 | 25,3761 | 12,6093 | 6,2083 | 2,5566 | 2,4220 |
| The cumulative (%) | 50,8277 | 76,2039 | 88,8132 | 95,0214 | 97,5780 | 100,0000 |

Graph 1. Graphical Representation of Both Cumulative Variabilities and Eigenvalues of Factors



The number of components was obtained by the Kaiser– Guttman rule. Table 2 as below presents the eigenvalue proportions of variance for selecting the optimal number of components. In PCA, the total eigenvalues of the correlation matrix were equal to the total number of variables being analyzed because each variable contributed one unit of variance to the data set. According to the Kaiser–Guttman rule, only the two first factors can be retained because those factors has an eigenvalue greater than one (3,0497 and 1,5226 for F1 & F2 respectively).

We conclude that the first factorial plane (F1, F2) which represents 76.20% of the inertia is the best in terms of representation for individuals and variables, it represents the greatest value of cumulative inertia.

Correlation study between variables and principal components:

Graph 2. Correlation Circle

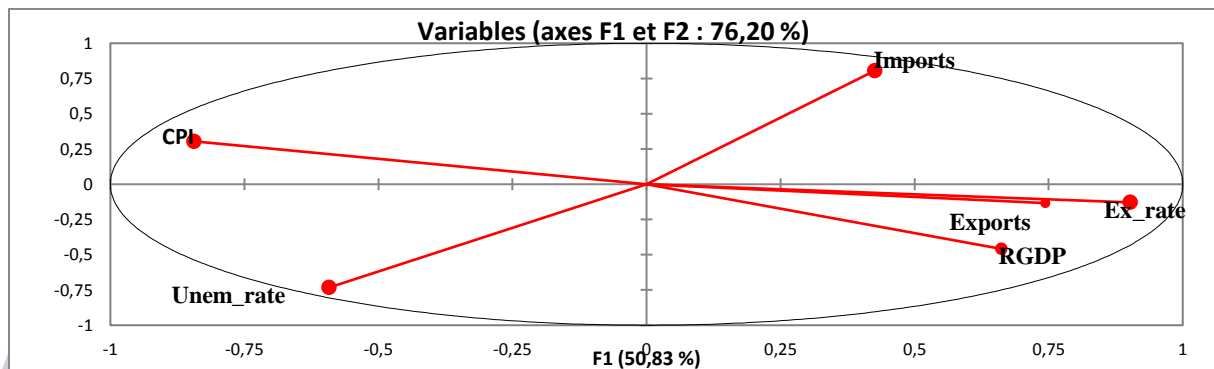


Table 3. Correlation for Variables and The First Factorial Plane (F1 And F2)

| Variables | Factors | |
|--------------------------|----------------|----------------|
| | F1 | F2 |
| RGDP | 0,6621 | -0,4588 |
| CPI | -0,8440 | 0,3043 |
| Exchange rate | 0,9024 | -0,1289 |
| Unemployment rate | -0,5918 | -0,7320 |
| Imports | 0,4260 | 0,8057 |
| Exports | 0,7436 | -0,1337 |

The representation of variables on the correlation circle provides a graphical synthesis of the correlation matrix.

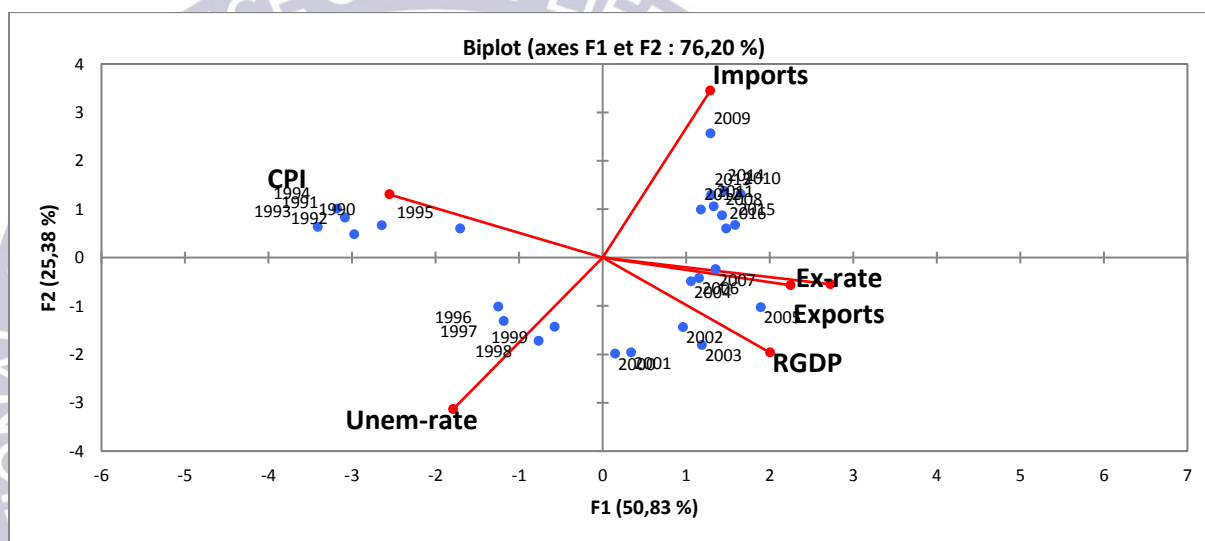
We see that the variables: exchange rate, export and CPI are well represented on F1 because their coordinates are high (0.9, 0.7, -0.8 respectively), and for the second axis is characterized by the variables import and unemployment rate (0.8, -0.7 respectively). We can say that F1 is the responsible for influencing currency.

The grouping of modalities makes it possible to observe the repulsions, that is to say the oppositions on the axes. We find that the exchange rate and the export are on the same side on F1 (the positive side) because these two variables are changed in the same direction, automatically that the CPI is in the opposite side because it has an inverse relationship with the exchange rate (negative correlation).

Note that most of the variables are well represented because they are close to the correlation circle.

Correlation study between variables and the position of individuals:

Graph 3. Simultaneous Representation of Variables and Individuals on The 1st Plane (F1, F2)



In the first axis F1, we note that the years from 1990 to 1995 are characterized by a relatively high inflation because Algeria was affected by the global oil crisis. The years 2002 to 2007 are featured by a relative increase in the RGDP, exchange rate and exports, we suppose that the reason refers to the improvement which is achieved in Algerian economy thanks to the evolution of the oil prices they reach 28 dollars in 2003 (during the same year the rate growth reaches its maximum value 7.2%).

In the second axis F2, we find that the year 2009 is characterized by a high value of imports because of the global financial crisis, and from 1996 to 2000 we remark that the unemployment rate increased because of the oil prices which declined by 12.6 dollars in 1998.

3.1.3. Johansen Cointegration And Granger Causality:

Causality in econometrics refers to the ability of one variable to predict the other. We suppose that we have two variables : y_t and x_t . It is possible to have that : y_t causes x_t and x_t causes y_t , in this case there is a bi-directional feedback (causality among the variables) (PALGRAVE MACMILLAN 2007).

According to (Engle and Granger 1987), a linear combination of two or more non-stationary series may be stationary provided that those (two or more) series must be integrated with the same order.

3.2.1. Stationarity of Variables

Table 4. Unit Root Test Results

| Variables | Phillips-Perron Unit root test | | | |
|----------------|--------------------------------|-------|------------------|--------|
| | Level | | First difference | |
| | t-statistic | Prob | t-statistic | Prob |
| LGDP | -0.31 | 0.90 | -4.81 | 0.0008 |
| LOil price | -1.09 | 0.70 | -4.01 | 0.05 |
| LUnemployment | -0.65 | 0.84 | -4.24 | 0.003 |
| LCPI | -2.15 | 0.22 | -7.56 | 0.000 |
| LExchange rate | -4.54 | 0.001 | - | - |
| LExports | -1.93 | 0.31 | -5.38 | 0.0002 |
| LImports | -1.84 | 0.35 | -6.59 | 0.0000 |

A series is said to be non-stationary if it has a non-constant mean, variance and autocovariance over time. If a non-stationary series has to be differenced d times to become stationary, then it is said to be integrated to the order of d .

The test statistic suggests the presence of a unit root at the level in LGDP, LOil price , Lunemployment , LCPI , LExports & LImports , except the LExchange rate which is stationary at level, while first differencing the series yields an apparent lack of a unit root in any of the series. To establish the presence of non- stationarity in each variable, the causality tests are performed on transformed data, i.e. the first difference.

3.2.2. Johansen Cointegration Test

The Co-integration test is used to study the long-term relationships between variables. Cointegration aims to determine if two or more series converge to form a long-term relationship, even if each series has a unit root. Johansen's (1988) cointegration test assumes that all variables are in the same order.

The null hypothesis for this test is the following: $H_0 = \beta_1 = \beta_2 = \beta_3 = \beta_4 = 0$

The rejection of the null hypothesis occurs when the trace statistic is greater than the critical values at 1% or 5% or 10% and this means that at least one of the coefficients is statistically significant (not equal to zero). In order to find the number of co-integrated vectors, Johansen applies a method of maximum eigenvalue.

Table 5. Trace Test

| hypothesized no,of Ce(s) | Eigenvalue | Trace Statistics | 0,05 critical value | prob |
|-----------------------------|------------|------------------|---------------------|-------|
| none* | 0.88 | 137.82 | 95.75 | 0.000 |
| At most 1 * | 0.73 | 83.06 | 69.82 | 0.003 |
| At most 2 * | 0.65 | 50.29 | 47.86 | 0.02 |
| At most 3 | 0.47 | 23.39 | 29.80 | 0.22 |
| At most 4 | 0.25 | 7.71 | 15.49 | 0.49 |
| At most 5 | 0.01 | 0.47 | 3.84 | 0.48 |

We know that LGDP, LOil price , Lunemployment , LCPI , , LExports & LImports are integrated of order 1. The Johansen Co-integration test has been applied and the results indicate that there are at least 3 co-integration vectors, which means that there is three long relationship term between our variables. We remark that the trace statistic 23.39 is lower than the critical value 29.8 . In addition ; the optimal lag of VAR is 2 according to AIC & SC criterion.

Granger causality test:

VECM contains crucial information about causal relationships and dynamic interactions between the variables included in the model. The existence of cointegration and the significance of the coefficients of the error correction terms for each time series clearly suggest the existence of a causal relationship in at least one of the cointegration variables. In order to analyze the short-term causal relationships between our variables : LGDP, LOil price , Lunemployment , LCPI , LExports & LImports in the VECM, we consider the statistics of χ^2 (Wald) for the significance of delayed endogenous variables in this equation.

NH: No Granger causality

AH: Null hypothesis is not true

Decision criteria: Reject the NH if the prob-value is of the F statistic is $\leq 5\%$

Table 6. Granger Causality Test (D(LCPI) is the dependent variable)

| Dependent variable : D(LCPI) | | | |
|------------------------------|----------|----|--------------|
| Excluded | χ^2 | df | prob |
| D(LGDP) | 20.01 | 1 | 0.000 |
| D(Loil_price) | 22.66 | 1 | 0.000 |
| D(Lexports) | 21.07 | 1 | 0.000 |
| D(Limports) | 2.84 | 1 | 0.091 |
| D(Lunem) | 0.35 | 1 | 0.550 |
| All | 24.04 | 5 | 0.0002 |

The NH is rejected in favour of the AH and conclude that oil prices has a short run causal effect on CPI at the 5% statistical significance level . (because 0.0 is lower than 0.05). In Algeria , lower oil prices may result a higher prices for consumer goods which causes a domestic inflation.

Table 7. Granger Causality Test (D(Lexports) is the dependent variable)

| Dependent variable : D(Lexports) | | | |
|----------------------------------|----------|----|---------------|
| Excluded | χ^2 | df | prob |
| D(LGDP) | 7.31 | 1 | 0.0068 |
| D(Loil_price) | 7.98 | 1 | 0.0047 |
| D(Lunem) | 0.10 | 1 | 0.742 |
| D(LCPI) | 2.84 | 1 | 0.269 |
| D(Limports) | 1.22 | 1 | 0.881 |
| All | 10.94 | 5 | 0.05 |

We reject the null hypothesises of no Granger causality , and we accept that oil prices cause exports (the prob 0.004 is lower than 5%) , at the short run , a high oil prices lead to increase exports , As the export of hydrocarbons represents more than 95% of total exports in Algeria, the increase of oil prices leads to the increase of all exports

3.2.3.Pairwise Granger Causality

Table 8. Pairwise Granger Causality between Unemployment Rate & Oil Price

| Null hypothesis | F-statistic | Prob |
|---|-------------|-------------|
| Unemployment does not Granger cause oil price | 1.14 | 0.33 |
| Oil price does not Granger cause unemployment | 2.66 | 0.09 |

The hypothesis of oil price does not cause unemployment is rejected because the p value of the F statistic is low than 0.10 (it is 0.09) , so here we identify a unit direction of causality relationship. In Algeria, a

high oil price can decline the unemployment rate which is a positive effect, and if oil price decreases the unemployment rate should be increase.

4.CONCLUSION

This study investigates the origin of fluctuations of six macroeconomic variables which are : Rate GDP, Consumer Price Index (CPI) , exchange rate, unemployment rate ; exports and imports, using annual data from 1990 to 2016 . We have applied two proceedings in order to find out what is the factor that causes the volatilities of our indicators , the first method is Principal Component Analysis (PCA) , its results suggest (suppose) that the variability of macroeconomic indicators is based on the changes in oil prices, while between 2002 and 2007 the RGDP, exchange rate and exports was relatively increased , we suppose that the reason refers to the improvement which is achieved in Algerian economy thanks to the evolution of oil prices they reached 28 dollars in 2003 (during the same year the rate growth reached its maximum value 7.2%). And from the years from 1996 to 1999 are characterized by an increase in unemployment rate because of the oil prices which decreased by 12.6 dollars in 1998. The next step of analysis based on the use of Johansen co-integration and Granger causality test , according to obtained results , there are at least 3 co-integration vectors, between the variables which are integrated of order one (LGDP, LOil price , Lunemployment , LCPI , LExports & LImports, except the LExchange rate which is I(0)) . Through the causality tests, it has been confirmed that oil prices affect CPI, exports and unemployment rate.

Oil exporting countries suffer from a weak economy which is dependent from oil revenues knowing that oil prices are volatile and uncertain. In order to minimize the harmful effects of these fluctuations, policy makers must diversify the domestic economy and unlink its economic activity from hydrocarbon sector revenues .

REFERENCES

- Abdoulkarim Esmaili And Zainabshokoohi (2011) “Assessing The Effect of Oil Price on World Food Prices: Application of Principal Component Analysis”, *Energy Policy* , 39: 1022–1025.
- Al Rasasi, M. And M. Yilmaz, (2016) “The Effects of Oil Shocks on Turkish Macroeconomic Aggregates”, *International Journal of Energy Economics and Policy*, 6(3): 471-476.
- Ayşen, E. And M. Mehmet, (2014) “The Effects of Oil Price on Economic Growth for Turkey”, 01 September. 12th International Academic Conference, Prague, Selcuk University, Turkey: 360-370.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Boudia Mounya, Fakhari Farouk And Zebiri Noura (2017) "The Current Economic Crisis in Algeria Between The Fluctuations of Oil Prices And The Exploitation of The Potential-ities Available For The Realization of The Economic Take-Off - Analytical Study -, Journal Of Economic & Financial Research , 4(2): 282-904.
- Brown, S. And M. Yücel (2002) "Energy Prices And Aggregate Economic Activity: An Interpretative Study." The Quarterly Review of Economics and Finance, 42: 193-208.
- Cologni, A., Manera, M.,(2008) "Oil Prices, Inflation and Interest Rates in A Structural Cointeg-Rated VAR Model for The G-7 Countries. Energy Econ. 30 (3): 856–888.
- Corden, W. M., And J. P. Neary (1982) "Booming Sector and De-Industrialization in A Small Open Economy", Economic Journal, 92: 825-848.
- Cunado, J., De Gracia, F.P., (2005) "Oil Prices, Economic Activity and inflation: Evidence for Some Asian Countries. Time Horiz. Rev. Econ. Financ. 45 (1): 65–83.
- Engle, R.F.,Granger,C.W.J.,(1987) "Co-Integration and Error Correction: Representation, Esti-Mation and Testing", Econometrica 55: 251–276.
- Erdoğan, M., K. İbrahim And G. Salih, (2016) "Transferring Marketable Securities Account Group of Tucoa to Opening Financial Statements According to New Turkish Trade Code as of Tfrs", Kastamonu Üniversitesi, İktisadi Ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi 11.
- Ftiti, Z., K. Guesmi, F. Teulon And S. Chouachi, (2016) "Relationship Between Crude Oil Prices and Economic Growth in Selected OPEC Countries. Journal Of Applied Business Research, 32(11): 11-22.
- Hamdi, H., and Sbia, R. (2013) "Dynamic Relationships Between Oil Revenues, Government Spending and Economic Growth In An Oil-Dependent Economy. Economic Modelling, 35: 118-125.
- Johansen, S. (1988) "Statistical Analysis of Cointegration Vectors", Journal Of Economic Dynamics And Control (12) 231-254. North-Holland.
- Khalid Ahmed, Niaz Ahmed Bhutto And Muhammad Ramzan Kalhoro (2018) "Decomposing The Links Between Oil Price Shocks And Macroeconomic Indicators: Evidence from SAARC Region", Resources Policy, 0301-4207.
- Negi, P., (2015) "Impact of Oil Price On Economic Growth: A Study Of Bric Nations". Indian Journal Of Accounting, 47(1): 144-155.

Nagmi M. Moftah Aimer (2016) "The Effects of Fluctuations of Oil Price on economic Growth of Libya", *Energy Economics Letters*, 3(2): 17-29.

Palgrave Macmillan (2007) "Applied Econometrics", Revised Edition, Houndmills, Basingstoke, Hampshire RG21 6XS And 175 Fifth Avenue, New York, N.Y. 10010; P281.

Saeed Moshiri (2014) "Asymmetric Effects of Oil Price Shocks in Oil-Exporting Countries; The Role of Institutions. The Canadian Economic Association Conference Held In Montreal In June 2013. P 4.

APPENDIX

Table 1. Optimal Lag of VAR

VAR Lag Order Selection Criteria

Endogenous variables: LGDP01 LPRIX_PETROLE LUNEM LCPI LEXPORTS LIMPORTS

Exogenous variables: C

Date: 11/11/18 Time: 20:47

Sample: 1990 2016

Included observations: 25

| Lag | LogL | LR | FPE | AIC | SC | HQ |
|-----|----------|-----------|-----------|------------|------------|------------|
| 0 | 18.26723 | NA | 1.51e-08 | -0.981378 | -0.688848 | -0.900243 |
| 1 | 115.2964 | 139.7221* | 1.25e-10 | -5.863715 | -3.816004* | -5.295767 |
| 2 | 162.6568 | 45.46597 | 9.07e-11* | -6.772546* | -2.969654 | -5.717785* |

* indicates lag order selected by the criterion

LR: sequential modified LR test statistic (each test at 5% level)

FPE: Final prediction error

AIC: Akaike information criterion

SC: Schwarz information criterion

HQ: Hannan-Quinn information criterion

**PARCACIK SÜRÜ OPTİMİZASYONU İLE PORTFÖY OPTİMİZASYONU: BORSA
İSTANBUL ULAŞTIRMA SEKTÖRÜ HİSSELERİ ÜZERİNE BİR UYGULAMA**

Burcu ADIGUZEL MERCANGOZ*

ÖZET

Optimizasyon, istenen faktörleri en üst düzeye çıkarıp, istenmeyenleri minimize ederek, verilen kısıtlar altında en uygun maliyetli ya da en yüksek performansa sahip çözümü bulmaktır. Bir anlamda optimizasyon bir şeyin daha iyisini gerçekleştirme sürecidir. Doğal olaylara dayalı optimizasyon algoritmaları olan sezgisel algoritmalar, basit ve kolay uygulanabilen algoritmalar. Modern finansa portföy optimizasyon problemlerinin çözümü önemli çalışma alanlarından biridir. Portföy optimizasyon problemi, belirli beklenti ve kısıtlar altında, tüm finansal varlıklar içinden en uygun olan alternatifin seçilmesine ilişkin çözüm arayışıdır. Portföy optimizasyon problemlerinde varlık havuzundan belirli bir risk düzeyinde en iyi getiriyi veren ya da belirli bir getiri düzeyinde en düşük riski veren varlıklar seçerek portföyler oluşturmak hedeflenmektedir. Bu çalışmanın amacı, Borsa İstanbul'da işlem gören ulaştırma sektörü hisse senetleri için, sezgisel algoritmalarından önemli biri olan Parçacık Sürü Optimizasyonu (PSO) algoritması kullanılarak minimum risk taşıyan optimum portföyü araştırmaktır. Bu amaçla çalışmada PSO Algoritması anlatılarak ilgili literatür taraması yapılmıştır. PSO'nun portföy optimizasyonu uygulaması için Borsa İstanbul'da işlem gören Ulaştırma Sektörü hisseleri ele alınmıştır. Ele alınan bu hisse senetlerinin kodları BEYAZ; CLEBİ, DOCO, GSDDE, PGSUS, RYSAS ve THYAO şeklinde olup, bu hisse senetlerinin fiyat verileri kullanılmaktadır. İlgili hisse senetleri için son üç yıllık günlük fiyat hareketlerinden logaritmik getiriler hesaplanmıştır. Bu getiriler kullanılarak minimum risk elde edilecek optimum portföy PSO ve Doğrusal Olmayan GRG teknikleri ile oluşturulmuştur. Elde edilen sonuçlar PSO yönteminin genellikle daha optimum sonucu verdiğini göstermiştir.

Anahtar Kelimeler: Parçacıklı Sürü Optimizasyonu, Portföy Optimizasyonu, Markowitz Ortalama-Varyans Modeli, Sürü Zekası, Sezgisel Algoritmalar.

JEL Kodları: C60, C61, 01.

* İstanbul Üniversitesi, Avcılar Kampüsü, İstanbul, burcua@istanbul.edu.tr

**PORTFOY OPTIMIZATION BY USING PARTICAL SWARM ALGORITHM AN
IMPLEMENTATION WITH TRANSPORTATION SECTOR SHARES IN BORSA
ISTANBUL**

ABSTRACT

Optimization is a technique that maximizes the desired factors or minimizes the unwanted factors under the given constraints with the most cost-effective or highest-performance alternatives. In a sense, optimization is the process of exploring something better. Optimization algorithms based on natural events are called Heuristic Algorithms. Heuristic algorithms, which are natural phenomena based optimization algorithms, are simple and easy to implement algorithms. In portfolio optimization problems, it is aimed to create portfolios by choosing the assets that gives the best return from the asset pool at a certain risk level or the least risky asset at a certain return level. The aim of this study is to investigate the optimum portfolio which has the minimum risk with the help of heuristic algorithms for the transportation sector stocks traded in Borsa Istanbul. For this purpose, Particle Swarm Optimization (PSO) Algorithm has been described and a literature review has been searched. Transport Sector stocks traded in Borsa Istanbul has been selected for the PSO's portfolio optimization application. The codes of these stocks that are used are WHITE; CLEBI, DOCO, GSDDE, PGSUS, RYSAS and THYAO and the price data of these shares are collected. Logarithmic returns were calculated from the daily price movements for the last three years. The optimum risk to be achieved by using these returns is based on PSO and Nonlinear GRG techniques. The results showed that the PSO method generally gived better results.

Keywords: *Partical Swarm Optimization, Portfolio Optimization, Heuristics, Swarm Intelligence, Markowitz Mean-Variance Model*

Jel Codes: *C60, C61, O16.*

1.GİRİŞ

Optimizasyon her alanda ihtiyaç duyulan bir araç olmaktadır. Optimizasyon Matematiksel modeller kullanılarak yapıldığı gibi doğa olaylarında esinlenen sezgisel algoritmalar ile de gerçekleştirilmektedir. Her geçen gün, sezgisel algoritmaların giderek artan bir kullanımı gerçekleştirilmektedir. Parçacık Sürü Optimizasyonu sezgisel yöntemlerden biridir. Bu teknik ilk defa

balık ve kuş sürülerinin toplu hareketlerinden ilham alınarak doğrusal olmayan sayısal problemlere optimum çözümler bulabilmek adına 1990'larda James Kennedy ve Russel Eberhart adında araştırmacılar tarafından ortaya konmuştur (Kennedy & Eberhart, 1995). Parçacık Sürü Optimizasyonu genellikle çok parametrelili ve çok değişkenli optimum sonuç aranan problemlere çözüm bulabilmek adına kullanılan popülasyona dayalı olan olasılık optimizasyon tekniğidir.

Portföy optimizasyonu problemi ise, yatırımcıların servetini çeşitli varlıklar arasında nasıl tahsis edeceği sorununa dayanmaktadır. Bu nedenle; portföy optimizasyon problemleri modern finans ve risk yönetiminde önemli araştırma alanlarından biri olmuştur. Geleneksel finans teorilerinin temel varsayımları arasında yatırımcının rasyonel olduğu ve riskten kaçtığı varsayımları bulunmaktadır. Bu nedenle genel olarak bir yatırımcı, varlık havuzundan oluşturacağı portföylerin mümkün olduğunca düşük bir risk karşısında mümkün olduğunca büyük bir getiri beklemektedir. Bu varsayımlar altında Markowitz, karesel bir programlama problemi olarak kabul edilen Ortalama-Varyans modelini önermektedir (Markowitz 1959). Bu modelin çözümünde bugüne kadar birçok farklı yöntem, yaklaşım ve algoritma ile çalışmalar yapılmıştır. Bu çalışmada ise sezgisel algoritmalar kullanılmıştır. Sezgisel algoritma sezgisel ya da buluşsal bir problem çözme yöntemi olarak genellikle bilgisayar bilimlerinde karşımıza çıkmaktadır. Sezgisel algoritmalar günlük hayatta her gün kullanılan yaklaşımlara benzer. Örneğin; bireyler bir yerden başka bir yere giderken yön duygularına dayanarak ve yolun bireyleri nereye çıkaracağını hiç bilmeden hareket etmeleri ve yol ayrımlarında sezgisel olarak seçim yapmaları böyle bir yaklaşımdır. Bir başka ifadeyle, tabiiattaki olaylardan ilham alınarak ortaya konan optimizasyon algoritmaları sezgisel algoritmalar olarak adlandırılmaktadır (Özsağlam & Cankuş 2008). Sezgisel algoritmalar örnek olarak; Genetik Algoritma (GA), Parçacıklı Sürü Optimizasyonu (PSO), Diferansiyel Evrim Algoritması (DEA), Tabu Araması (TA), Benzetimli Tavlama (BT) ve Yapay Sinir Ağları (YSA) sayılabilir. Aşağıdaki literatürde de ayrıntılarına değinildiği üzere sezgisel algoritmalar içerisinde optimizasyon problemlerinde sıklıkla kullanılanların Genetik Algoritma ve Parçacıklı Sürü Optimizasyonu Algoritması olduğunu görmek mümkündür.

Henry Markowitz portföy optimizasyonuna ilişkin yaptığı meşhur çalışmasında oluşturduğu portföyün getiri ve riski arasındaki ilişkiyi Ortalama-Varyans modeli olarak isimlendirmiş ve geliştirdiği bu model ile belirli getiri düzeylerinde, portföyün riskini yani varyans ya da standart sapmasını minimum kılan mümkün olan tüm portföyleri bularak bunlara etkin portföyler demiştir. Markowitz Ortalama-Varyans modelinde portföy içinde yer alacak varlık sayısı kısıtı eklenmektedir. Eleman sayısında kısıt getirilen portföy optimizasyon problemleri NP-Zor kategorisindedir. Bu kategorideki problemlerin çözümünde genellikle sezgisel yöntemlere başvurulmaktadır. Çünkü kesin çözüm üreten algoritmalar ile makul bir zaman diliminde çözüm oldukça zordur Akyer vd. (2018). Bu çalışmada

portföy seçim probleminde Markowitz Ortalama-Varyans modeli ve bu modelin optimum çözümleri için Parçacık Sürü Optimizasyonu (PSO) yaklaşımları kullanılmıştır.

Portföy optimizasyon problemi çözümleri için Borsa İstanbul da işlem gören Ulaştırma Sektörü hisseleri ele alınmıştır. Ele alınan bu hisse senetlerinin kodları BEYAZ; CLEBİ, DOCO, GSDDE, PGSUS, RYSAS, TLMAN ve THYAO şeklindedir. İlgili hisse senetleri için son üç yıllık günlük fiyat hareketlerinden logaritmik getiriler hesaplanmıştır. Markowitz portföy optimizasyon problemi PSO ve Doğrusal Olmayan GRG yöntemleri kullanılarak çözülmüş, beklenen risk, getiri ve hisse senetlerinin hesaplanan portföy ağırlıkları ile ilgili çıkan sonuçlar karşılaştırılmıştır.

31.08.2015-31.08.2018 arası kapsayan son 3 yıllık verilerle PSO ve Doğrusal Olmayan GRG yöntemlerine göre oluşturulan optimal portföylerin risk ve getirileriyle hesaplanan değişim katsayıları PSO yönteminin genellikle daha optimum sonuçlar verdiğini göstermiştir.

2. LİTERATÜR TARAMASI

Wolfe (1959) portföy optimizasyon problemini simplex algoritması ile çözmeye çalışmıştır, Crama vd. (2003) ve Derigs & Nickel (2004) ise bu problemlerde tavlama benzetimine yönelik teknikler kullanmışlardır. Doerner vd. (2004)'in çalışmasında portföy optimizasyonu problemlerinde Pareto Karınca Koloni Optimizasyonu tekniğini kullanılmış ve elde edilen sonuçlar sezgisel yöntemlerle elde ettikleri sonuçlar ile karşılaştırılmasını yapmıştır. Fernandez & Gomez (2007) ise ilgili problemlerin çözümünde Yapay Sinir Ağları tekniklerini kullanmışlardır. Chang vd. (2000) ise portföy optimizasyon probleminin çözümünde; Genetik Algoritma (GA), Tavlama Benzetimi ve Tabu Arama vb.. farklı sezgisel teknikleri bir arada kullanmışlardır. Lai vd. (2006) çalışmalarında Şanghai Borsası'nı incelemişler ve rasgele seçtikleri 100 şirkete ilişkin verilerle iki aşamalı Genetik Algoritma tekniğini kullanmışlardır. Çalışmanın sonucunda GA tekniğiyle oluşturulacak portföylerin en uygun ve en yararlı portföyler olduğu gösterilmiştir.

Bu çalışmada Parçacıklı Sürü Optimizasyonu Algoritması kullanılarak portföy optimizasyon problemi çözülmeye çalışıldığından, burada bu konudaki literatürün ayrıntılarına yer verilmiştir.

Kendal & Su (2005), Chen vd. (2006), Fernandez & Gomez (2007), Cura (2009) ve Zhu vd. (2011), Sun et al. (2011), Golmakani & Fazel (2011), Deng vd. (2012), Corazza vd. (2013), Kamali (2014), Abuelfadl (2017) portföy optimizasyon probleminin çözümünde parçacık sürü optimizasyonu tekniğini kullanmışlardır.

Kendall & Su (2005) tarafından yapılan "optimal riskli portföylerin oluşturulmasına yönelik PSO yaklaşımı" konulu çalışması ve Fernández & Gómez (2007) tarafından yapılan "Sinir Ağları kullanarak

Portföy seçimi” çalışması sürü zekasının portföy optimizasyonu alanındaki uygulamalara yer vermiş ve bu çalışmalarda PSO tekniği kullanılarak optimum portföyü oluşturan getiri risk düzeyleri hesaplanmaya çalışılmıştır.

Cura (2009), PSO tekniğini bir portföy optimizasyon problemine uygulamıştır. Çalışmanın sonuçları Genetik Algoritmaları, Benzetimli Tavlama ve Tabu Arama yaklaşımları ile karşılaştırmış, bulgular PSO yaklaşımının portföy optimizasyonunda başarılı olduğunu göstermiştir. Mishra vd. (2009) portföy optimizasyon problemini herhangi bir yatırım kısıtı getirmeden Çok Amaçlı Parçacıklı Sürü Optimizasyonu ve Baskın Sıralı Genetik Algoritma-II (BSGA-II) ile çözmüş ve sonuçları karşılaştırmıştır. Sonuçlar Çok Amaçlı Parçacıklı Sürü Optimizasyonun BSGA-II yöntemini göre daha üstün olduğunu göstermiştir.

Zhu vd. (2011), makalelerinde PSO tekniğini kullanarak portföy optimizasyon problemlerine meta-sezgisel bir yaklaşım sunmuştur. Model birçok kısıtlı ve kısıtsız riskli yatırım portföylerinde test edilmiş ve Genetik Algoritmalar ile karşılaştırmalı bir çalışma yapılmıştır. PSO modeli, optimal portföyü (burada optimal portföy belirli bir risk üzerinde maksimum getiriyi veren portföydür) bulma konusunda etkin bir çözüm ortaya koymuştur. İlk sonuçlar, yaklaşımın çok ümit verici olduğunu göstermiş ve devamında elde edilen sonuçlara iyileşmiştir. PSO performansının gelişimi için hibrit tekniklerin geliştirilmesini önermişlerdir.

Sun vd. (2011) makalelerinde, PSO tekniğinin yeni bir modelini geliştirerek portföy optimizasyon probleminde kullanmışlardır. Yeni PSO modelini, klasik PSO, genetik algoritma (GA) ve iki klasik optimizasyon çözücüsü (LOQO ve CPLEX) performansını; etkin sınırlar, uygunluk değerleri, yakınsama oranları ve hesaplama zamanı tüketimi açısından karşılaştırmışlardır. Deneme sonuçları, yeni PSO'nun diğer test edilmiş optimizasyon modellerine kıyasla portföy optimizasyon problemini çözmede daha etkili olduğunu göstermiştir.

Golmakani & Fazel (2011) da aynı şekilde Markowitz ortalama varyans portföy seçim modeli PSO ve GA yöntemlerini kullanmış, bilgisayar sonuçları önerilen PSO'nun özellikle büyük ölçekli problemlerde GA'yı geride bıraktığını göstermiştir. Markowitz ortalama varyans portföy seçim modelleri minimum işlem lotu, sektör kapitilasyonu gibi farklı kısıtlarda içermekteydi. Corazza vd (2013) fon yönetimi uygulamasında kullanılan birçok kısıtlamaları içeren alan doğrusal olmayan karma-tamsayı portföy seçim modelini kullanmışlardır. Standart bir tam ceza fonksiyonunun getirildiği karışık tamsayı modelinin yeni bir reformülasyonuna PSO uyguladılar.

Kamali (2014), portföy seçim problemi için bir Markowitz ortalama-varyans modeli için PSO ve GA algoritmasını kullanmış ve sonuçlar bir PSO yaklaşımının portföy optimizasyonu için uygun olduğunu göstermiştir.

Abuelfadl (2017) bireysel yatırımcıların ticaret modellerini ve performansını incelemiştir. Tam örneklem sonuçları, bu örneklemdeki ortalama bireysel yatırımcının küçük ancak istatistiksel olarak anlamlı kârlar sağlayabileceğini göstermektedir. Çalışma aynı zamanda bireysel yatırımcıların bu etkiyi ortaya koyduğunu ve bu nedenle de örneklemdeki kazananlar ile kaybedenler arasındaki geniş çaplı farkı açıkladığını ortaya koymuştur. Çalışmada, tarihsel verilere dayalı optimizasyon teknikleri ve bireysel yatırımcıların alım satım verilerinin eğilim noktaları olarak kullanımı araştırılmıştır. Kantitatif Partide Swarm Optimizasyon algoritmasında, bu ikincisinin kısa vadeli yatırım ufku için daha iyi optimizasyon sonuçları ürettiği bulunmuştur.

Portföy optimizasyon problemlerinde PSO algoritmasını kullanan çalışmaların sonuçlarından da anlaşılabilir gibi, PSO, sezgisel bir yöntem olarak iyi sonuçlar vermektedir. Çalışma ulaştırma sektörü hisse senetleri ele alınarak yapıldığından literatüre bu bakımdan farklı bir katkı sağlamaktadır.

3.YÖNTEM

Tabiiatta gözlemlenen olaylardan ilham alınarak geliştirilen optimum sonucu bulmaya yönelik algoritmaları sezgisel algoritmalar olarak adlandırılmaktadır (Özsağlam & Cankuş, 2008). Bu çalışmada portföy seçim probleminin çözümü için Markowitz Ortalama-Varyans modelinin optimum çözümleri için Parçacık Sürü Optimizasyonu (PSO) ve Doğrusal Olmayan GRG yöntemleri kullanılmıştır.

Portföy optimizasyonu problemi basit haliyle klasik sayısal teknikler ile kolay bir şekilde çözüme ulaşılabilen bir problemdir. Ancak, portföy içindeki varlıklara ilişkin çeşitlendirme gerçekleştiriminin avantajlarından faydalanmak ve portföyün toplam riski en aza indirebilmek için çok sayıda varlıklara az miktarlarda yatırım yapma stratejisi, portföy oluştururken bazı zorlukları da beraberinde getirmektedir. Bahsedilen yatırım stratejileri özellikle yüksek işlem maliyetlerinden ve çok sayıda menkul kıymeti aynı anda yönetebilmenin zorluğundan dolayı pratikte hiç kolay değildir. Bu tip zorlukları elimine etmek için sermayenin menkul kıymetlere dağıtılması konusunda bazı kısıtlar konabilir. Portföydeki menkul kıymet sayısı sınırlandırılabilir veya her bir menkul kıymete yatırılan sermaye paylarına alt-üst sınırlar konabilir. Konulan tüm bu kısıtlar, portföy optimizasyon probleminin klasik optimizasyon yöntemleriyle çözülmesini zorlaştırmaktadır (Akyer vd., 2018) Bu tip problemlerde kesin çözüm sunan matematiksel modeller ile her zaman optimal çözümler elde etmek mümkün değildir. Bu nedenle bu tip problemlerin çözümünde PSO tekniği uygun hale gelmektedir.

Devam eden bölümde; Parçacık Sürü Optimizasyonu (PSO) yaklaşımları ile Markowitz Ortalama-Varyans modelinin ayrıntılarından bahsedilmiştir.

4.PSO ALGORİTMASI

Tabiattaki sürüler, kendi aralarında etkileşen dağınık yapılı kendine has yapıları olan bireyler topluluğu olarak ifade edilmektedir. Sürülerde her bir birey yani temsilci belirli bir amaca yönelik davranışı ortaya koymak ve sonuçta da bir hedefe ulaşmak adına toplu olarak birlikte hareket etme eğilimindedirler. Dışarıdan gözlemlenebilen bu kolektif zekâ bireyler kendi aralarında tekrarladıkları hareketlerden kaynaklanmaktadır. Bireyler aktivitelerini koordine etmek için sezgisel olarak basit kurallar geliştirmekte ve topluluğun geri kalan kısmı da bu bireylerle etkileşime girerek sonuçta sürü hedeflerine ulaşmaktadır. Topluluğun kendi içindeki grup aktivitelerinin tamamından bir anlamda kendini kendine organize etme sonucu doğmaktadır. Temsilci ya da parçacık diyebileceğimiz her bir birey harekete geçtiğinde, kendi konumunun uygunluk değeri, bir başka ifadeyle hedefe ne kadar uzaklıkta olduğu hesap edilir. Bir birey, konumunu, çözüm kümesindeki her boyutta hangi hızla ilerlediğini, o ana kadar elde edebildiği optimum uygunluk değerini, kendi komşularının en iyi konumlarını ve son olarak da bu değeri yakalayabildiği konumunu hafızada tutmalı ve bu şekilde sürü hedefe ulaşmalıdır (Akyol, 2012).

PSO tekniği popülasyon temelli olasılığa dayalı bir optimizasyon yöntemidir. Genellikle çok değişkenli optimizasyon problemlerinin çözümlerinde kullanılmaktadır (Alataş, 2007).

PSO tekniği, evrimsel hesaplama yöntemleriyle benzerlikleri bulunmaktadır. Sistem ilk olarak rastgele çözümler üretilerek başlatılır ve bu popülasyonlardan nesiller güncellenerek optimum çözüm araştırılır. PSO yönteminde parçacık olarak ifade edilen muhtemel çözümler, o anda optimum parçacığı takip ederek problem uzayında hareket eder. PSO'nun klasik optimizasyon tekniklerinden en temel farkı herhangi bir türev bilgisine ihtiyaç hissetmemesidir. Bahsedilen bu fark ve PSO'ya has özellik; birçok optimizasyon problemin çözümünde karşımıza çıkan karışık ve zor işlemlerin minimuma indirmesine sağlayan bir avantaj yaratmaktadır. Ayrıca PSO algoritmasında parametre sayısı oldukça az olup yöntemin kullanımını daha basit hale getirmektedir (Zhao 2005).

PSO yönteminin balık ve kuş sürülerinin hareketlerinin bir benzetimi olduğu yukarıda vurgulanmıştır. Örneğin balıkların denizde, nerede olduğunu bilmediği bir yiyeceği aramaları, belirli bir problem için çözüm arayışına benzetilmektedir. Balıklar bu yiyeceği ararken bu yiyeceğe en yakın olan arkadaşı balığı takip etmektedirler. Parçacık olarak ifade edilen her bir çözüm, arama uzayında içindeki bir balık anlamında gelmektedir. Bu parçacıklardan her biri harekete geçtiğinde, kendi konum ve koordinatını bir fonksiyona yönlendirir ve bu şekilde bu parçacığın uygunluk değeri hesaplanmış olur.

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES**

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Bir başka ifadeyle, yiyeceğe uzaklığının ne olduğu ölçülmüş olmaktadır. Temsilci bireyler kendilerinin ve komşularının tecrübelerine göre harekete geçmektedirler, bu şekilde bireyler kendi aralarında bilgi paylaşımı gerçekleştirmektedirler.

4.1.PSO Parametreleri

PSO parametrelerinin neler olduğu, ne anlama geldikleri ve hangi değerler arasında olması gerektiği Tablo. 1' de özetlenmektedir.

Tablo 1. PSO Parametreleri

| Parametreler | Açıklamaları |
|-------------------------------------|---|
| Parçacık Sayısı (Sürü Büyüklüğü; n) | Genel olarak 20-40 arasında bir değer alınmaktadır. |
| Parçacıkların boyutu (d) | Bu parametre problemdeki değişken sayısını gösterir. |
| Öğrenme Faktörleri | Formüldeki c_1 ve c_2 öğrenme faktörlerini ifade etmektedir. Bunların genel olarak 2 olarak alınmasının iyi sonuçlar verildiği gözlemlenmiştir. |
| Durma Koşulu (Sonlandırma Kriteri) | Çözüm üretilirken nerede durulacağına ilişkin sonlandırma kriteri algoritmaya eklenmektedir. |
| İterasyon Sayısı | İyi bir çözüme ulaşmak için yineleme sayısı da probleme bağlıdır. |
| Parçacık Aralığı | Optimum sonucu aradığımız probleme göre değişen farklı boyutlarda ve aralıklarda parçacıklar tanımlanabilmektedir. |
| V_{max} | Her bir iterasyon sonucunda parçacıkta oluşan maksimum değişikliği yani hızı belirlemektedir. |

4.2.PSO Aşamaları

PSO algoritması rasgele üretilmiş bir popülasyon çözümünüyle başlatılmakta ve güncellemelerle en uygun çözüm araştırılmaktadır. Her denemede yani iterasyon sonunda her bir parçacık iki farklı “en iyi” değerlere göre güncellenmektedir. İlk en iyi değer; bir parçacığın o ana kadar ulaştığı en iyi uygunluk değeri olup, bu değer daha sonraki aşamalara kullanılmak üzere hafızaya alınır, ilgili en iyi değer “ p_{best} ”

(*personal best*) olarak isimlendirilir. İkinci en iyi değer ise; popülasyon içindeki farklı bir parçacık tarafından o ana kadar elde edilen en iyi uygunluk değerine sahip çözümü ifade etmektedir. Bu değer popülasyon içindeki en iyi değer olup, "*g_{best}*" (*global best*) olarak adlandırılır.

Parçacık popülasyonu; d adet parametreden oluşan, n adet parçacık için popülasyon matrisi Eşitlik.1'de görüldüğü gibi ifade edilmektedir.

$$\begin{bmatrix} x_{11} & \dots & x_{1d} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ x_{n1} & \dots & x_{nd} \end{bmatrix} \quad (1)$$

Matrise göre, i. parçacık (x_i) ile p_{best} ve g_{best} formülleri sırasıyla Eşitlik 2, 3 ve 4 te verilmektedir.

$$x_i = [x_{i1}, x_{i2}, \dots, x_{iD}] \quad (2)$$

$$p_{best}_i = [P_{i1}, P_{i2}, \dots, P_{iD}] \quad (3)$$

$$g_{best}_i = [P_1, P_2, \dots, P_D] \quad (4)$$

Ayrıca hız vektörü, yani parçacık i nin, her bir konumdaki değişim miktarı aşağıdaki Eşitlik.5'deki şekilde ifade edilmektedir.

$$v_i = [v_{i1}, v_{i2}, \dots, v_{iD}] \quad (5)$$

p_{best} ve g_{best} en iyi değerlerinin bulunması aşamasından sonra; parçacığın hız ve konumu sırasıyla aşağıdaki (6) ve (7) numaralı denklemlere göre güncellenir.

$$v_{ij}^{t+1} = w * v_{ij}^t + c_1 r_1^t [p_{best}_{ij}^t - x_{ij}^t] + c_2 r_2^t [g_{best}_j^t - x_{ij}^t] \quad (6)$$

for $i = 1, \dots, N$ and $j = 1, \dots, n$.

$$x_{ij}^t = x_{ij}^t + v_{ij}^{t+1} \quad (7)$$

Eşitlik 7 ile parçacığın yeni pozisyonu, Eşitlik 6 ile de parçacığın yeni hızı hesaplanmaktadır. İlgili denklemlerde; r_1 ve r_2 ; rand yani 0 ila 1 arasında üretilecek rasgele sayıları ifade etmektedir. i parçacığın numarasını, k ise iterasyon sayısını ifade etmektedir. Eylemsizlik (atalet) ağırlığı olan w her iterasyonda doğrusal olarak azaltılmalı ve birden küçük seçilmelidir. c_1 ve c_2 öğrenme faktörleridir. PSO yönteminde hedef süreç içerisinde hesaplanan her bir parçacığın p_{best} değeri yani kendisinin en iyi pozisyonu ile sürünün g_{best} değeri yani en iyi pozisyonunu referans alarak sürü içerisindeki tüm parçacıkları olası en optimum noktalara hareket ettirmektedir. Öğrenme faktörleri parçacıkları p_{best} ve g_{best} konumlarına doğru hareket ettiren sabitlerdir. c_1 olarak simgelenen öğrenme faktörü parçacığın kendisini tecrübelerine göre, c_2 olarak simgelenen öğrenme faktörü ise sürüdeki diğer parçacıkların

tecrübelerine göre davranışa yönlendirmektedir. Öğrenme faktörlerinde küçük değerler alınması parçacıkların hedef bölgeye doğru çekilmeden önce, ilgili bölgeden daha uzak yerlerde hareket etmelerine olanak vermektedir. Ancak bu durumda hedefe ulaşma süresi de uzayabilecektir. Diğer taraftan, büyük değerler alınması, hedefe daha hızlı ulaşmayı sağlamakta ancak beklenmedik davranışlara ve hedef bölgenin es geçilmesine neden olabilmektedir.

4.3. Markowitz Ortalama-Varyans Modeli

20. yy'ın ilk yarısında yatırım bilimi gelişmeye başlamış olup, ilk başlarda menkul kıymetler bireysel olarak ele alınıp analiz edilmiş ve bireysel seçimler üzerine odaklanılmış olmakla beraber, 1950'lerde Markowitz tarafından ilk yapı taşları oluşturulan Modern Portföy Teorisinde (MPT) yatırımlara yeni bir bakış açısı gelmiştir. Bu yeni bakış açısında yatırımlara ilişkin kararlar verilirken menkul kıymetleri bireysel olarak ele almak yerine tüm piyasayı el alan MPT; yatırımcılar için daha sistematik bir yaklaşım geliştirmiş ve menkul kıymetlerin birbirleriyle olan ilişkileri de değerlendirilerek portföy oluşturulmuştur. MPT; yatırımcıların rasyonel olduğunu varsaymakta ve rasyonel yatırımcıların portföy içindeki varlıklarının payını portföyün getirisini en yüksek seviyeye getirirken, portföyün riskini de en aza indirecek biçimde seçtiğini varsaymaktadır. Markowitz'in Portföy seçimi adlı meşhur çalışmasında; varlıklar havuzundan oluşturulan portföyün getirisi ile riski arasındaki ilişkiyi ortalama-varyans modeli ile modellemişler ve bu model ile belli bir getiri düzeyinde, portföy riskini yani varyansını en az yapan mümkün olan tüm portföyleri bulmuş, bunlara da etkin portföy demişlerdir. Riskli portföy oluştururken varlık seçim modeli olan Markowitz Ortalama-Varyans modeli aşağıdaki eşitlikler yardımıyla açıklanmıştır.

Markowitz modelinde rasyonel yatırımcıları elde etmek istediği getiri düzeyinde riski minimize etmeye çalıştığı kabul edilmektedir. Bu yaklaşımla Markowitz modelinde portföyün beklenen getirisi ve riski aşağıdaki gibi hesaplanmaktadır.

Beklenen getiri Eşitlik.8 ile formüle edilir.

$$E(r_p) = \sum_{i=1}^n w_i E(r_i) \quad (8)$$

Portföyün beklenen getirisini veren yukarıdaki formüle göre portföy beklenen getirisi; her bir varlığın beklenen getirilerinin, portföy içindeki ağırlıkları ile çarpılması sonucu elde edildiği anlaşılmaktadır. Burada n portföydeki varlık sayısını, w_i i varlığının portföy içindeki ağırlığını ve $E(r_i)$ i varlığının beklenen getirisini ifade etmektedir.

Kovaryans matrisi kullanarak çok sayıda varlıktan oluşan bir portföyün riskinin hesaplaması için Eşitlik.9'daki eşitlik kullanılmaktadır.

$$\text{Var}(r_p) = \sigma_p^2 = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n w_i w_j \text{Cov}(r_i, r_j) \quad (9)$$

MPT'de Markowitz; portföyü oluşturan menkul kıymetlerin getirileri arasındaki ilişkileri inceleyerek tam pozitif korelasyona sahip olmayan başka bir ifadeyle korelasyon katsayıları 1'den küçük olan hatta mümkünse negatif olan menkul kıymetlerin portföye dahil edilmesinin hedeflenen getirinin portföy riskini de azaltarak elde edilebileceğini göstermiştir (Akyer, 2018).

Markowitz Ortalama-Varyans modelini kullanarak gerçekleştirilecek portföy optimizasyon probleminin matematiksel formülü aşağıdaki gibi doğrusal olmayan programlama modelidir.

Amac Fonksiyonu

$$\min. \text{Var}(r_p) = \sigma_p^2 = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n w_i w_j \text{Cov}(r_i, r_j) \quad (10)$$

Kısıtlar

$$\sum_{i=1}^n w_i = 1$$

$$0 \leq w_i \leq 1 \quad i = 1, 2, \dots, n$$

Elimizde bulunan toplam sermayenin belirli varlıklar arasında dağılımı yapılarak oluşturulan bir portföy söz konusu olduğu için varlıkların portföy içindeki ağırlıklarının toplamı 1 olması gerekmektedir. Ayrıca her bir varlığın ağırlığının sıfırdan büyük olması kısıtı açığa satış olmayacağı hususunu temin etmiş olmaktadır.

5.UYGULAMA

PSO tekniğinde 'fitness function' olarak adlandırılan uygunluk fonksiyonu olarak parçacıkların en iyi değerlerinin hesaplanmasında Markovitz'in portföy riski formülü kullanılmaktadır. Bu fonksiyon minimize edilerek en düşük riskli uygun çözüm aranmaktadır. Burada risklerin minimize edilmesi amaçlanmaktadır. Risk minimum seviyeye çekilmeye çalışılan portföy içerisinde yer alacak tüm hisse senetlerinin toplam ağırlığının 1'e eşit olması gerekmektedir. Bu kısıtı PSO algoritmasının içerisinde başlangıç çözümünün oluşturulmasında kullanılan uniform dağılıma göre rastgele verilen değerler normalize edilerek modele dahil edilmiştir.

6.ARAŞTIRMA VERİSİ

Çalışmamızda Borsa İstanbul'da işlem gören ulaştırma hisse senetleri için optimum portföy araştırılmıştır. Uygulamada 31.08.2015-31.08.2018 dönemini kapsayan son 3 yıllık günlük fiyat verileri ile çalışılmıştır. Fiyat verilerinden Eşitlik.11 formül yardımıyla logaritmik getiriler hesaplanmıştır.

$$R_t = \ln(P_t/P_{t-1}) \quad (11)$$

Borsa İstanbul'da işlem göre sekiz adet ulaştırma hisse senedi bulunmaktadır. Bu hisse senedi bilgileri Tablo.2' teki gibidir. TLMAN hisse senedi 13 Ocak 2018'de halka açılmıştır, son üç yıllık verisi bulunmamaktadır. Bu nedenle çalışmamızda BEYAZ, CLEBI, DOCO, GSDDE, PGSUS, RYSAS ve THYAO hisse senetleri fiyat verileri kullanılmaktadır.

Tablo 2. Borsa İstanbul'da İşlem Gören Ulaştırma Sektörü Hisse Senetleri

| | Hisse Kodu | Şirket İsmi |
|---|------------|--|
| 1 | BEYAZ | BEYAZ FİLO OTO KİRALAMA A.Ş. |
| 2 | CLEBI | ÇELEBİ HAVA SERVİSİ A.Ş. |
| 3 | DOCO | DO & CO AKTIENGESELLSCHAFT |
| 4 | GSDDE | GSD DENİZCİLİK GAYRİMENKUL İNŞAAT SANAYİ VE TİCARET A.Ş. |
| 5 | PGSUS | PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş. |
| 6 | RYSAS | REYSAŞ TAŞIMACILIK VE LOJİSTİK TİCARET A.Ş. |
| 7 | TLMAN | TRABZON LİMAN İŞLETMECİLİĞİ A.Ş. |
| 8 | THYAO | TÜRK HAVA YOLLARI A.O. |

Kaynak: KAP (Kamuyu Aydınlatma Platformu)

Çalışmada kullanılan 7 hisse senedine için hesaplanan; ortalama logaritmik getiri, varyans ve standart sapma değerleri aşağıdaki Tablo.3'te verilmektedir.

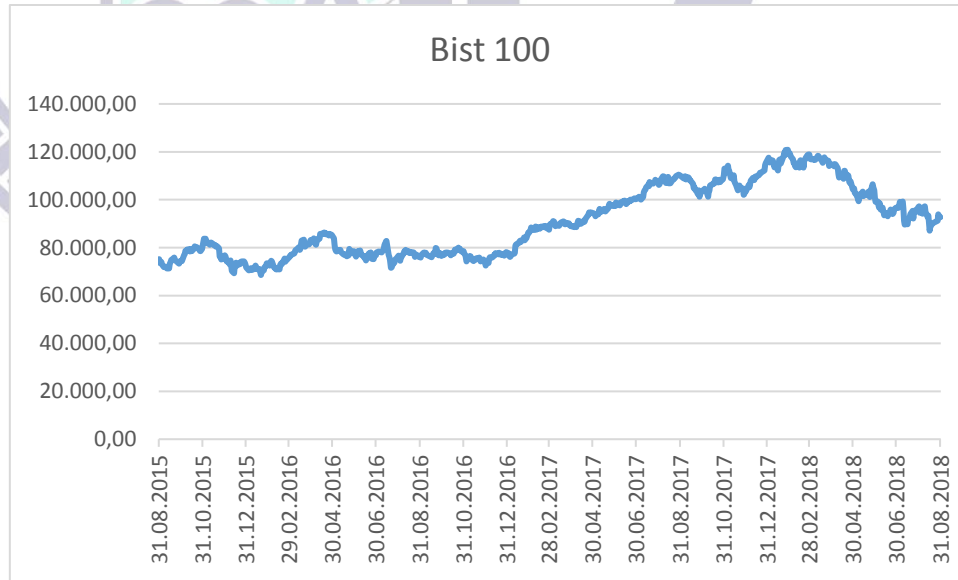
Tablo 3. Ulaştırma Hisse Senetlerine ait Hesaplanan Risk ve Getiri Değerleri

| | BEYAZ | RYSAS | CLEBI | DOCU | PGSUS | THYAO | GSDDE |
|------------------|-----------|-----------|----------|----------|--------|----------|---------|
| Ort. Log. Getiri | 0,0025293 | 0,0003205 | 0,000773 | 0,000798 | 0,0003 | 0,000933 | -0,0002 |
| Varyans | 0,0578355 | 0,02298 | 0,022967 | 0,021685 | 0,0239 | 0,023398 | 0,02734 |
| Standart Sapma | 0,0033449 | 0,0005281 | 0,000527 | 0,00047 | 0,0006 | 0,000547 | 0,00075 |

Tablo.3'te görülen 31.08.2015-31.08.2018 dönemini kapsayan son 3 yıllık verilerden hesaplanan ulaştırma sektör hisse senetleri ortalama getirilerinin GSDDE hisse senedi haricinde pozitif olduğu görülmektedir. İlgili döneme ilişkin olarak 7 hisse senedinin ortalama getirisi hesaplanmış günlük bazda 7 hisse senedi ortalama getirisi %0,078 olarak hesap edilmiştir. Bu değer yıllık bazda %28'e denk gelmektedir. İlgili ortalama değerler negatif ortalama getiriye sahip GSDDE hariç olarak hesaplandığında günlük bazda 7 hisse senedi ortalama getirisi %0,094, yıllık bazda %34'e denk gelmektedir.

Aynı döneme ilişkin Bist 100 endeks değerleri incelenmiş ve aşağıdaki şekilde grafik haline getirilmiştir. Bist 100'ün özellikle son bir yıldır düşme eğiliminde olduğu grafikten görülebilmektedir.

Şekil 1. 31.08.2015-31.08.2018 Dönemi BİST 100 Endeks Gelişimi



31.08.2015-31.08.2018 dönemine ilişkin BİST 100 endeks getirileri hesaplanmış ve aynı döneme ilişkin günlük ortalama getiri %0,12 olarak hesap edilmiştir. Bu yıllık bazda %4,40'a denk gelmektedir.

Görüldüğü gibi 31.08.2015-31.08.2018 döneminde BİST 100 ortalama yıllık getirisi %4,40 iken ulaştırma sektörü hisselerinin ortalama yıllık getirisi %28 olarak hesap edilmiştir. Sektörün piyasadaki düşüş trendinden olumsuz etkilenmediği anlaşılmaktadır.

Tek başına getirilerin incelenmesinin yeterli olmayacağı, ilgili analizde risklerin de dikkate alınması gerektiği açıktır. Bu nedenle 31.08.2015-31.08.2018 dönemine ilişkin ulaştırma sektörü değişim katsayısı da hesap edilip, BİST 100 ile karşılaştırılmıştır. Değişim Katsayısı; her bir birim getiri için ne kadar risk alındığı gösteren bir ölçüttür. Başka bir ifadeyle portföy yönetiminde kullanılan değişim katsayısı; menkul kıymetlerin sağladıkları getirilere karşılık risklerinin ne olduğunu analiz etmede kullanılan bir araçtır. Tablo.4'te 31.08.2015-31.08.2018 dönemine ilişkin Ulaştırma sektörü hisse senetleri ve BİST 100 ortalama getiri ve değişim katsayısı değerleri görülmektedir.

Tablo 4. Ulaştırma Sektörü Hisse Senetleri ve BIST 100 Değişim Katsayıları

| | BIST100 | BEYAZ | RYSAS | CLEBI | DOCO | PGSUS | THYAO | GSDDE |
|--------------------------|----------|-----------|----------|----------|----------|---------|----------|----------|
| Ortalama getiri | 0,00012 | 0,00253 | 0,00032 | 0,00077 | 0,00080 | 0,00030 | 0,00093 | -0,00020 |
| Varyans | 0,00003 | 0,0578355 | 0,02298 | 0,022967 | 0,021685 | 0,0239 | 0,023398 | 0,02734 |
| Standart sapma | 0,00550 | 0,0033449 | 0,000528 | 0,000527 | 0,00047 | 0,0006 | 0,000547 | 0,00075 |
| Değişim Katsayısı | 45,85481 | 1,32246 | 1,64774 | 0,68176 | 0,58897 | 2,00000 | 0,58628 | -3,75000 |

Değişim katsayısı sonuçları GSDDE hariç diğer ulaştırma sektörü hisse senetlerinin bir birim getiriye karşın çok daha az risk üstlenildiğini göstermektedir.

Yukarıdaki genel bir analizin sonuçlarının da gösterdiği üzere önemli bir yatırım alternatifi olarak görülebilecek ulaştırma sektörü hisse senetlerinden optimum portföy oluşturulmasına ilişkin bir çalışma bu açıdan literatüre önemli bir katkı sağlamış olacaktır. 7 adet ulaştırma hisse senedine ait Varyans-Kovaryans matrisi Tablo.5'te görülmektedir.

Tablo 5. Ulaştırma Hisse Senetlerini Varyans Kovaryans Matrisi

| | BEYAZ | REYSAŞ | ÇELEBİ | DOCO | PEGASUS | THYAO | GSDDE |
|---------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BEYAZ | 0,00946707 | 0,000100924 | -0,000167711 | -4,45111E-05 | 3,71862E-05 | -5,1972E-05 | -0,000110205 |
| REYSAŞ | 0,00010092 | 0,001494609 | 0,000527476 | 4,65912E-05 | 0,000641862 | 0,00063884 | 0,000529223 |
| ÇELEBİ | -0,00016771 | 0,000527476 | 0,001492924 | 0,000220289 | 0,000688413 | 0,000682876 | 0,000408904 |
| DOCO | -4,4511E-05 | 4,65912E-05 | 0,000220289 | 0,001330851 | 7,70173E-05 | 0,00011968 | 5,68345E-05 |
| PEGASUS | 3,7186E-05 | 0,000641862 | 0,000688413 | 7,70173E-05 | 0,001616854 | 0,001139224 | 0,000574559 |
| THYAO | -5,1972E-05 | 0,00063884 | 0,000682876 | 0,00011968 | 0,001139224 | 0,001549417 | 0,000500849 |
| GSDDE | -0,0001102 | 0,000529223 | 0,000408904 | 5,68345E-05 | 0,000574559 | 0,000500849 | 0,002114885 |

7. BULGULAR

PSO ile 4 farklı iterasyon ve popülasyon sayıları ile denemeler yapılmıştır. Sonuçlar Tablo.6’da verilmektedir. Kendi içlerinde yakın ağırlıklar vermesine rağmen Doğrusal Olmayan GRG ile elde edilen ağırlıkların çok da benzerlik göstermediği görülmektedir.

Tablo 6. Doğrusal Olmayan GRG ve PSO ile Elde Edilen Optimal Portföy Ağırlıkları

| | PSO | | | | Doğrusal Olmayan GRG |
|---------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| | 100 iterasyon nPop:30 | 100 iterasyon nPop:50 | 500 iterasyon nPop:30 | 500 iterasyon nPop:50 | Hisse Senedi Ağırlıkları |
| BEYAZ | 0,1824 | 0,0959 | 0,2159 | 0,1940 | 0,0588 |
| REYSAŞ | 0,1220 | 0,2119 | 0,1861 | 0,1504 | 0,1718 |
| ÇELEBİ | 0,1445 | 0,2088 | 0,1205 | 0,0789 | 0,1350 |
| DOCO | 0,0593 | 0,0244 | 0,0930 | 0,0872 | 0,3467 |
| PEGASUS | 0,1146 | 0,2463 | 0,1230 | 0,2127 | 0,0708 |
| THYAO | 0,2406 | 0,0027 | 0,1419 | 0,2470 | 0,0858 |
| GSDDE | 0,1366 | 0,2101 | 0,1196 | 0,0298 | 0,1307 |

Tablo 7. PSO ve Doğrusal Olmayan GRG Yöntemlerine Göre Optimal Portföy Risk ve Getirileri

| | Optimal Portföy PSO 1 | Optimal Portföy PSO 2 | Optimal Portföy PSO 3 | Optimal Portföy PSO 4 | Optimal Portföy Doğrusal Olmayan GRG |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------------|
| Portfolio Return | 0,00089136 | 0,0005285 | 0,00091948 | 0,00096357 | 0,000659421 |
| Portfolio Var | 0,00056404 | 0,00054834 | 0,00058923 | 0,00055943 | 0,000519753 |
| Portfolio Std Dev | 0,02374953 | 0,0234167 | 0,02427406 | 0,02365227 | 0,022798081 |

Tablo.7’ de görülebileceği üzere PSO ve Doğrusal Olmayan GRG yöntemleri kullanılarak elde edilen sonuçlar birbirine yakın değerler vermektedir. Ancak yine burada hangi yöntemin daha iyi sonuçlar verdiğini görmek adına değişim katsayıları hesaplanmıştır.

Tablo 8. Hesaplanan Optimum Portföylerin Değişim Katsayıları

| | Optimal Portföy PSO 1 | Optimal Portföy PSO 2 | Optimal Portföy PSO 3 | Optimal Portföy PSO 4 | Doğrusal Olmayan GRG |
|------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|
| Değişim Katsayısı | 26,64422 | 44,31117 | 26,3997 | 24,54638 | 34,57288 |

Yukarıdaki değişim katsayılarını veren tabloya göre PSO yöntemi (nPop = 50 ile 100 iterasyon hariç) Doğrusal Olmayan GRG yöntemine göre daha optimal sonuçlar vermiştir.

8. SONUÇ VE ÖNERİLER

31.08.2015-31.08.2018 dönemine ilişkin Ulaştırma sektörü ve BIST 100 hesaplanan değişim katsayıları ulaştırma sektöründe bir birim getiriye karşın çok daha az risk üstlenildiğini göstermektedir. Bu nedenle önemli bir yatırım alternatifi olarak görülebilecek ulaştırma sektörü hisse senetlerinden optimum portföy oluşturulmasına ilişkin bir çalışma bu açıdan literatüre önemli bir katkı sağlayacağı düşünülmektedir. Yapılan çalışma ile Markowitz portföy optimizasyon probleminin çözümünde PSO ve Doğrusal Olmayan GRG yöntemleri kullanılarak sonuçlar elde edilmiş ve bu değerler karşılaştırılmıştır. Yapılan bu çalışma Türkçe literatüre konu ile ilgili değer katması bakımından ve PSO'nun finans alanında özellikle ulaştırma hisseleri üzerinde bir uygulama örneği vermesi bakımından önem arz etmektedir. İleriki çalışmalarda sezgisel algoritmaların kendi aralarındaki performanslarını değerlendirmek üzere farklı sezgisel algoritmalar kullanılarak çalışma tekrarlanabilir ve bu algoritmalar kendi aralarında değerlendirilebilir. Ayrıca bu çalışmada sadece riskin minimize edilmesi amaçlanarak getiri ile ilgili herhangi bir kısıt verilmemiştir. İleriki çalışmalarda beklenen getirinin belirli bir seviyede olması kısıtı da ilave edilerek çalışma tekrarlanabilir.

KAYNAKÇA

- Akyer, H., Kalaycı, C.B., Aygören, H. (2018) "Ortalama-Varyans Portföy Optimizasyonu için Parçacık Sürü Optimizasyonu Algoritması: Bir Borsa İstanbul Uygulaması", Pamukkale Üni. Müh. Bilim Dergisi, 24(1): 124-129.
- Akyol, S., Alataş, B. (2012) "Güncel Sürü Zekâsı Optimizasyon Algoritmaları", Nevşehir Üniversitesi Fen Bilimleri Enstitü Dergisi 1 (2012) 36-50: 38.
- Chang, T.J., Meade, N., Beasley, J.E., and Sharaiha, Y. M. (2000) "Heuristics For cardinality Constrained Portfolio Optimisation", Computers and Operations Research, 27: 1271-1302.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Chen, W., Zhang, R.T., Cai, Y.M., Xu F.S. (2006) “Particle Swarm Optimization for Constrained Portfolio Selection Problems”, In: Proceedings of the Fifth International Conference on Machine Learning and Cybernetics, Dalian, 2425–2429.
- Crama, Y., Schyns, M. (2003) “Simulated Annealing for Complex Portfolio Selection Problems”, European Journal of Operational Research, 150: 546– 571.
- Cura T. (2009) “Particle Swarm Optimization Approach to Portfolio Optimization”, Nonlinear Analysis: Real World Applications, 10 (4): 2396-2406.
- Demirtaş, Ö., Güngör, Z. (2004) “Portföy Yönetimi ve Portföy Seçimine Yönelik Uygulama”, Havacılık ve Uzay Teknolojileri Dergisi, 1(4): 103-109.
- Derigs, U., Nickel, N.H. (2004) “On a Local-Search Heuristic for a Class of Tracking Error Minimization Problems in Portfolio Management”, Annals of Operations Research, 131: 45–77.
- Doerner, K., Gutjahr, W.J., Hartl, R.F., Strauss C., Stummer, C. (2004) “Pareto Ant Colony Optimization: A Metaheuristic Approach to Multiobjective Portfolio Selection”, Annals of Operations Research, 131: 79-99.
- Feldman, K., Treleven, P. (1994) “Intelligent Systems in Finance”, Applied Mathematical Finance, 1 (2): 195-207.
- Fernandez, A., Gomez, S. (2007) “Portfolio Selection Using Neural Networks”, Computers and Operations Research, 34: 1177–1191.
- Goldberg, D.E. (1989) “Genetic Algorithms in Search, Optimization, and Machine Learning”, Addison-Wesley, Reading, MA.
- Gökçe, G. A., Cura, T. (2003). İMKB Hisse Senedi Piyasalarında İyi Çeşitlendirilmiş Portföy Büyüklüğünün Araştırılması, Yönetim, yıl: 14, sayı: 44, Şubat, s. 63-81
- Lai, K. K., Yu, L., Wang, S. ve Zhou, C. (2006) “A Double-Stage Genetic Optimization Algorithm for Portfolio Selection”, Lecture Notes in Computer Science 42(34): 928-937.
- Lin, C. C. ve Liu, Y. T. (2008) “Genetic Algorithms for Portfolio Selection Problems with Minimum Transaction Lots”, European Journal of Operational Research, 185: 393-404.
- Markowitz, H. (1956) “The Optimization of a Quadratic Function Subject to Linear Constraints”, Naval Research Logistics Quarterly, 3: 111–133.
- Markowitz, H. (1959) “Portfolio Selection, Efficient Diversification of Investments”, New York: Wiley.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Oh, K. J., Kim, T. J., Min, S. H., Lee, H. Y. (2006) "Portfolio Algorithm Based on Portfolio Beta using Genetic Algorithm", *Expert Systems with Applications*, 30: 527–534.
- Özdemir, M. (2011) "Genetik Algoritma Kullanarak Portföy Seçimi", *İktisat İşletme ve Finans*, yıl: 26 (299): 43-66.
- Özsağlam, M.Y., Cankuş, M. (2008) "Optimizasyon Problemlerinin Çözümü için Parçacık Sürü Optimizasyonu Algoritması", *Politeknik Dergisi Journal of Polytechnic*, 11 (4): 299-305.
- Pereira, R. (2000) "Genetic Algorithm Optimisation for Finance and Investment", *Latrobe University School of Business Discussion Papers*.
- Söke, A., Bingül, Z. (2004) "Genetik Algoritmaların Farklı Çaprazlama Teknikleriyle İki Boyutlu Kesme Problemlerine Uygulanışı", *Politeknik Dergisi*, 7 (1).
- Wang, S. M., Chen, J. C., Wee, H. M., ve Wang, K. J. (2006) "Non-linear Stochastic Optimization Using Genetic Algorithm for Portfolio Selection", *International Journal of Operations Research*, 3 (1): 16-22
- Wolfe, P. (1959) "The Simplex Method for Quadratic Programming", *Econometrica*, 27: 382 -398
- Yang, X. (2006) "Improving Portfolio Efficiency: A Genetic Algorithm Approach", *Computational Economics*, 28: 1–14.
- Zhao, F., Ren, Z., Yu, D., Yang, Y. (2005) "Application of An Improved Particle Swarm Optimization Algorithm for Neural Network Training", *IEEE 0-7803-9422*.
- Zhu H., Wang Y., Wang K., Chen Y. (2011) "Particle Swarm Optimization (PSO) for the Constrained Portfolio Optimization Problem", *Expert System with Applications*, 38 (8): 10161-10

**İŞ STRESİ, MESLEKTAŞ İLİŞKİLERİ VE BİREYSEL PERFORMANS İLİŞKİLERİ:
LOJİSTİK SEKTÖRÜNDE BİR ARAŞTIRMA**

Burcu Özge ÖZASLAN ÇALIŞKAN*

ÖZET

Bu çalışmada iş stresi, meslektaş ilişkileri ve bireysel performans ilişkilerinin incelenmesi amaçlanmıştır. Literatürden hareketle, iş stresi ve bireysel performans arasında ters yönlü bir ilişkinin, meslektaş ilişkileri ile bireysel performans arasında ise pozitif yönlü bir ilişkinin bulunması beklenmektedir. Bağımsız değişkenler olarak iş stresi ve meslektaş ilişkileri, bağımlı değişken olarak ise bireysel performans ele alınmıştır. Araştırma modelinin test edilmesinde korelasyon ve regresyon analizi varsayımları dikkate alınacaktır.

Çalışmada Türkiye'deki lojistik işletmelerinin depolarında çalışan 500 kişi üzerinde gerekli analizler yapılmıştır. Çalışma gerçekleştirilirken zaman ve maliyet kısıtları sebebiyle lojistik sektöründe faaliyet gösteren işletmelerde çalışan 500 kişi araştırmaya dahil edilebilmiştir. Araştırmada veri toplamak için geliştirilen anket formunda İş Stresi Ölçeği ve Meslektaş İlişkileri Ölçeği (Severinsson ve Kamaker(1999)) ile Bireysel Performans Ölçeği (Motowildo ve Borman(1993)) kullanılmıştır. Anket formları kolayda örnekleme yöntemi kullanılarak katılımcılara ulaştırılmıştır.

Anahtar Kelimeler: İş Stresi, Meslektaş İlişkileri, Bireysel Performans

JEL Kodları: D23, M12, M1.

ABSTRACT

The concept of performance is generally examined in the literature as individual and organizational performance. Considering individual performance behaviors; it is noteworthy that it differs in the form of task and contextual performance dimensions. Task performance behaviors cover basic technical skills and activities related to a person's occupation and job. Contextual performance

* Associate Professor, PhD, Adress: Istanbul University, Transportation and Logistics Faculty, Avcılar, İstanbul
E-mail: ozaslan@istanbul.edu.tr, Phone Number: +90 212 473 70 70 (19238)

behaviors include assisting colleagues, making extra efforts and developing the organization as a member.

In this study, it is aimed to investigate the relationship between job stress, peer relations and individual performance. From the literature, it is expected that there will be a negative relationship between job stress and individual performance and a positive relationship between peer relations and individual performance.

Work stress and colleague relations are considered as independent variables and individual performance is considered as the dependent variable. Correlation and regression analysis assumptions will be taken into account when testing the research model. Related analysis was performed on 500 people who are working in warehouses of logistics enterprises in Turkey. In the questionnaire developed for collecting data, the Work Stress Scale and Colleague Relationships Scale (Severinsson and Kamaker (1999)) and the Individual Performance Scale (Motowildo and Borman (1993)) were used. The questionnaires were delivered to the participants using the convenience sampling method.

Keywords: *Work Stress, Colleague Relationships, Individual Performance*

JEL Codes: *D23, M12, M1.*

1. GİRİŞ

Günümüzde işletmelerin en önemli amaçları arasında örgütsel performansı sağlamak yer almaktadır. Literatürde yer alan çalışmalarda örgütsel performansı arttırabilmek için organizasyonda yer alan çalışanların bireysel performanslarının yükseltilmesi gerekliliği sıkça ele alınan bir konu olarak dikkat çekmektedir.

İşletmelerde çalışanlara yönelik psikolojik faktörler ve çalışma ortamındaki sosyal atmosfer, çalışanların performansı üzerinde değişimlere neden olabilmektedir. Çalışanların meslektaşları ile ilişkileri, işletmedeki diğer bölümlerle iletişim kurma becerileri, ekibe uyum sağlama yetenekleri gibi hususlar bireysel ve örgütsel performans düzeyleri üzerinde etkili olmaktadır. Ayrıca organizasyon yapısı, motivasyon, sosyal destek gibi örgütsel unsurların da çalışanların performansı üzerinde olumlu etkilere sahip olduğu bilinmektedir (Staal, 2004).

Bu çalışmada literatür taramasından hareketle birbiriyle ilişkilerinin önemli olduğu düşünülen iş stresi, meslektaş ilişkileri ve bireysel performans değişkenleri arasındaki ilişkiler ele alınmıştır. İş stresi ve meslektaş ilişkileri değişkenlerinin bireysel performansa nasıl etki ettiği ortaya konulmaya çalışılmıştır.

2. İŞ STRESİ, MESLEKTAŞ İLİŞKİLERİ VE BİREYSEL PERFORMANS KAVRAMLARI

İş stresi; işgöreni normal fonksiyonlarından alıkoyan, psikolojik veya fiziksel davranışlarını değiştiren, işle ilgili faktörler sonucunda oluşan psikolojik bir durum. İşgörenin iş yerindeki stres kaynaklarını algılaması durumu ve bunlara vermiş olduğu tepkiler (Wilson vd., 2004: 574). İş stresi ise işgöreni normal fonksiyonlarından alıkoyan, psikolojik veya fiziksel davranışlarını değiştiren, işle ilgili faktörler sonucunda oluşan psikolojik bir durumdur. Başka bir deyişle iş stresi, işgörenin iş yerindeki stres kaynaklarını algılaması durumu ve bunlara vermiş olduğu tepkiler olarak tanımlanmaktadır (Wilson vd., 2004: 574).

Performans kavramı literatürde genellikle bireysel ve örgütsel performans olmak üzere iki boyutta incelenmektedir. Bireysel performans davranışları ele alındığında; görev ve bağlamsal performans boyutları şeklinde ayrıştığı dikkat çekmektedir. Görev performansı davranışları; bir kişinin mesleği ve işi ile ilgili temel teknik beceri ve faaliyetleri kapsamaktadır. Bağlamsal performans davranışları ise; meslektaş ve mesai arkadaşlarına yardımcı olma, ekstra çaba sarf etme, rol ötesi davranışlarda bulunma ve üyesi olunan organizasyonu geliştirme gibi hususları içermektedir (Miller and et al., 1999: 8). Meslektaş ilişkileri, iş ortamına etki eden önemli faktörlerden birini oluşturmaktadır. Çalışanlar işini sevmeseler dahi iş arkadaşları sayesinde işinden mutluluk duyarak çalışma yaşamından zevk almaya başlayabilirler (Özkalp ve Kirel, 2005). Çalışanların meslektaşları ile ilişkileri, diğer birimler ile koordinasyon kurma becerileri, takım içi uyum gösterme kabiliyetleri de bireysel ve örgütsel performans düzeyleri üzerinde etkili olmaktadır (Jensen vd., 2001).

Çalışanlar, yaptıkları işten sadece para veya somut başarı beklememektedirler. Günlük yaşantısının yarısından fazlasını iş yerinde çalışarak geçiren kişi, uyumlu iş arkadaşlarıyla birlikte sosyalleşme içerisindedir. Bu nedenle çalıştığı işletmede dostlar ve destekleyici iş arkadaşları bulan çalışanın iş tatmini artmaktadır (Karadal & Çuhadar, 2008)

Yönetimin çalışanların psikososyal ihtiyaçlarını karşılamalarına yardımcı olmak için iş yerindeki sosyal ilişkileri güçlendirmeye yönelik çaba harcaması iş tatmini ve performansı artırmada yararlı bir uygulama olacaktır (Bozkurt & Bozkurt, 2008).

3. ARAŞTIRMA METODOLOJİSİ

3.1. Araştırmanın Amacı, Önemi ve Katkısı

Bu çalışmada iş stresi, meslektaş ilişkileri ve bireysel performans ilişkilerinin incelenmesi amaçlanmıştır. Bu konuda ilgili yazın incelendiğinde iş stresi, meslektaş ilişkileri, bireysel performans gibi algıya yönelik araştırmaların pek çok farklı sektör çalışanı üzerinde gerçekleştirildiği dikkat çekse

de, lojistik sektörü açısından konuyu ele alan çok fazla çalışmanın yer almadığı dikkat çekmiştir. Bu anlamda araştırmanın akademik anlamda literatüre katkı sağlayacağı düşünülmektedir.

3.2. Araştırmanın Kapsamı ve Sınırlılıkları

Çalışmada Türkiye'deki lojistik işletmelerinin depolarında çalışan 500 kişi üzerinde gerekli analizler yapılmıştır. Çalışma gerçekleştirilirken zaman ve maliyet kısıtları sebebiyle lojistik sektörde faaliyet gösteren işletmelerde çalışan 500 kişi araştırmaya dahil edilebilmiştir. Bu büyüklükteki örneklem anakütlenin bilinmediği durumlarda anakütleyi temsil edecek büyüklükte bir örneklem olarak kabul edilir.

3.3. Araştırmada Kullanılan Ölçekler

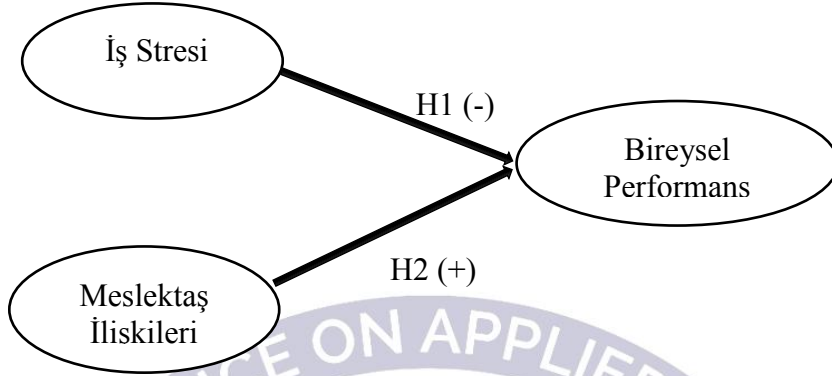
Araştırmada veri toplamak için geliştirilen anket formunda İş Stresi Ölçeği ve Meslektaş İlişkileri Ölçeği (Severinsson ve Kamaker (1999)) ile Bireysel Performans Ölçeği (Motowildo ve Borman (1993)) kullanılmıştır. İş stresini ölçmek üzere 8, meslektaş ilişkilerini ölçmek üzere 10 ve bireysel performans ölçmek üzere ise 17 ifadeden yararlanılmıştır. Ölçekler beşli Likert tipinde geliştirilmiştir.

3.4. Araştırma Modeli ve Hipotezler

Literatür taraması doğrultusunda iş stresi, meslektaş ilişkileri ve bireysel performans arasındaki ilişkilerin ele alındığı farklı çalışmalar olduğu dikkat çekmiştir. Bu doğrultuda söz konusu araştırma da bu değişkenler arasındaki ilişkileri incelemek üzere aşağıdaki H1 ve H2 hipotezleri test edilmeye çalışılmıştır. Buna göre; iş stresi ve bireysel performans arasında ters yönlü bir ilişkinin, meslektaş ilişkileri ile bireysel performans arasında ise pozitif yönlü bir ilişkinin bulunması beklenmektedir. Bağımsız değişkenler olarak iş stresi ve meslektaş ilişkileri, bağımlı değişken olarak ise bireysel performans ele alınmıştır. Araştırma modelinin test edilmesinde korelasyon ve regresyon analizi varsayımları dikkate alınmıştır.

H1: İş stresi ve bireysel performans arasında ters yönlü bir ilişki bulunmaktadır.

H2: Meslektaş ilişkileri ile bireysel performans arasında ise pozitif yönlü bir ilişki bulunmaktadır.



3.5. Analiz ve Bulgular

Anket formları kolayda örnekleme yöntemi kullanılarak katılımcılara ulaştırılmıştır. Hipotezleri test etmek üzere basit regresyon analizinden yararlanılmıştır. Araştırmada kullanılan ölçeklerin güvenilirliklerini ölçmek amacıyla Cronbach Alpha güvenilirlik analizinden ve geçerliliklerini test edebilmek içinse faktör analizinden yararlanılmıştır. Yapılan basit regresyon analizi sonucunda lojistik işletmelerinin depolarında çalışan 500 mavi yakalı çalışandan elde edilen bulgular değerlendirilmiştir. Bunun sonucunda çalışanların iş stresinin bireysel performansları üzerinde negatif bir etkisi olduğu, meslektaş ilişkilerinin bireysel performans üzerinde pozitif bir etkisi olduğu ortaya çıkmıştır.

Tablo1. Ölçeklerin Güvenilirlik Analizi Bulguları

| Güvenilirlik İstatistikleri | | | |
|-----------------------------|------------------|--|------------|
| | Cronbach's Alpha | Cronbach's Alpha Based on Standardized Items | N of Items |
| İş Stresi Ölçeği | 0,903 | 0,903 | 8 |
| Meslektaş İlişkileri Ölçeği | 0,873 | 0,872 | 10 |
| Bireysel Performans Ölçeği | 0,971 | 0,971 | 17 |

Ölçeklerin güvenilirliğini test etmek amacıyla Cronbach Alpha Güvenilirlik analizinden yararlanılmıştır. Ölçeklerin güvenilirlik analizi bulguları Tablo 1'de gösterildiği gibidir. Buna göre; Cronbach Alpha değerlerinin 0,70'in üzerinde olması bize ölçeklerin ayrı ayrı güvenilir olduğu sonucunu vermektedir.

Faktör analizinin uygulanabilir olup olmadığı hususunda örneklem yeterliliği ve değişkenler arası

korelasyon anlamlılığına bakan Kaiser-Meyer-Olkin(KMO) ve Bartlett testleri yapılmıştır. Ölçeklerin geçerliliğini test etmek amacıyla yapılan faktör analizine ilişkin KMO ve kümülatif açıklayıcılık değerleri Tablo 2’de gösterilmiştir. Her bir ölçekte kullanılan ifadelerin tek faktör altında toplandığı gözlenmiştir.

Tablo 2. Ölçeklerin Geçerlilik Analizi Bulguları

| | | |
|-----------------------------|----------------------------------|--|
| İş Stresi Ölçeği | KMO değeri | 0,893 |
| | Faktör yapısı | 8 ifade tek faktör altında toplanmıştır |
| | Ölçeğin kümülatif açıklayıcılığı | % 67,253’dir |
| Meslektaş İlişkileri Ölçeği | KMO değeri | 0,705 |
| | Faktör yapısı | 10 ifade tek faktör altında toplanmıştır |
| | Ölçeğin kümülatif açıklayıcılığı | % 63,567’dir |
| Bireysel Performans Ölçeği | KMO değeri | 0,786 |
| | Faktör yapısı | 17 ifade tek faktör altında toplanmıştır |
| | Ölçeğin kümülatif açıklayıcılığı | %64,528 |

Araştırmaya katılanların iş stresi ortalamaları, meslektaş ilişkileri ortalamaları ve bireysel performans ortalamaları Tablo 3’de gösterildiği gibidir. Buna göre en yüksek ortalamanın meslektaş ilişkileri ortalaması olduğu dikkat çekmektedir. Burada dikkat çeken bir diğer husus bireysel performans ortalamasının çok yüksek çıkmamış olmasıdır. Genel olarak araştırmalarda performansa ilişkin algı ölçülürken katılımcıların yüksek puanlara yönelme eğilim olduğu bilinmektedir. Bu araştırmada bireysel performans ortalamasının çok yüksek çıkmaması katılımcıların tarafsız ve objektif bir değerlendirme yaptıklarının göstergesi olarak kabul edilebilir.

Tablo 3. Ölçek Ortalamaları

| ORTALAMALAR | |
|--------------------------------------|------|
| İş Stresi Ortalaması | 3,14 |
| Meslektaş İlişkileri Ortalaması | 3,55 |
| Bireysel Performans Genel Ortalaması | 3,4 |

Araştırma hipotezlerini test etmek amacıyla yapılan regresyon analizleri için bu analizlere yönelik varsayımlar incelenmiştir. Verilerin normal dağıldığı (kutu-bıyık diyagramı ve histogram eğrileri ve

çarpıklık-basıklık değerleri normal değerler arasında yer almaktadır) ve çoklu doğrusal bağlantı olmadığı varsayımı ile regresyon analizleri yapılmıştır. Regresyon analizine ilişkin bulgular Tablo 4’de gösterilmiştir.

Tablo 4. Regresyon Analizi Bulguları

| Bireysel Performansı Etkileyen Değişkenler | | | | | |
|--|------------------|------|-------|--------|----------------|
| Bağımsız Değişken | Beta (β) | t | p | R | R ² |
| İş Stresi | -0,253 | 2,66 | 0,000 | -0,253 | 0,067 |
| Meslektaş İlişkileri | 0,418 | 5,64 | 0,000 | 0,418 | 0,215 |

4. SONUÇ VE ÖNERİLER

Regresyon analizi bulgularına göre; çalışanların iş stresinin bireysel performansları üzerinde negatif bir etkisi olduğu, meslektaş ilişkilerinin bireysel performans üzerinde pozitif bir etkisi olduğu ortaya çıkmıştır. Meslektaş ilişkileri ve bireysel performans arasındaki regresyon analiz sonucuna bakıldığında, meslektaş ilişkilerinin bireysel performansın 0,215’ini açıklayabiliyor olduğu ve regresyon modelinin anlamlı olduğu tespit edilmiştir. Diğer bir ifadeyle bu değer neden sonuç ilişkisinin varlığına işaret etmektedir. Meslektaş ilişkilerinin bireysel performans üzerindeki pozitif etki katkısı 0,418’dir (beta katsayısı) İki değişken arasında pozitif yönlü orta düzeyde bir ilişki vardır. İş stresi ve bireysel performans arasındaki regresyon analiz sonucuna bakıldığında, iş stresinin bireysel performansın 0,067’sini açıklayabiliyor olduğu ve regresyon modelinin anlamlı olduğu tespit edilmiştir. Diğer bir ifadeyle bu değer neden sonuç ilişkisinin varlığına işaret etmektedir.

İş stresinin bireysel performans üzerindeki negatif etki katkısı -0,253’dür (beta katsayısı). İki değişken arasında negatif yönlü zayıf düzeyde bir ilişki vardır.

İleriki çalışmalarda bireysel performans etki ettiği düşünülen farklı değişkenler birlikte ele alınarak bağımsız değişken üzerindeki etkileri bakımından incelenebilir. Anakütlenin gerçek büyüklüğü dikkate alındığında genelleme amacına gerçeğe yakın düzeyde ulaşabilmek için daha büyük bir örnekleme çalışmak ileriki çalışmalar için hedeflenmiştir.

KAYNAKÇA

Borman, W. C., and Motowidlo, S. J. (1997) “Task Performance and Contextual Performance: The Meaning for Personnel Selection Research”, Human performance, 10(2): 99-109.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Bozkurt, Ö., ve Bozkurt, İ. (2008) “İş Tatminini Etkileyen İşletme İçi Faktörlerin Eğitim Sektörü Açısından Değerlendirilmesine Yönelik Bir Alan Araştırması”.

Griffin, M., Neal, A., and Neale, M. (2000) “The contribution of task performance and contextual performance to effectiveness: Investigating the role of situational constraints”, *Applied Psychology*, 49(3): 517-533.

Jensen, S. S., Berkowicz, R., Hansen, H. S., and Hertel, O. (2001) “A Danish Decision-Support GIS Tool for Management of Urban Air Quality and Human Exposures”, *Transportation Research Part D: Transport and Environment*, 6(4): 229-241.

Karadal, H., Ay, U., and Cuhadar, M. T. (2008) “The Effect of Role Conflict and Role Ambiguity on Job Satisfaction and Organizational Commitment: A Study in the Public and Private Sectors”, *The Journal of American Academy of Business*, Cambridge, 13(2): 176-181.

Özkalp, E. ve Kirel, Ç. (2005) “Örgütsel Davranış, Anadolu Üniversitesi Eğitim”, *Sağlık ve Bilimsel Araştırma Çalışmaları Vakfı Yayın No: 149*, Eskişehir.

Severinsson, E. I., and Kamaker, D. (1999) “Clinical Nursing Supervision in the Workplace--Effects on Moral Stress and Job Satisfaction”, *Journal of Nursing Management*, 7(2): 81-90.

Staal, M. A. (2004) “Stress, Cognition, and Human Performance: A literature Review and Conceptual Framework”.

Wilson, M. G., Dejoy, D. M., Vandenberg, R. J., Richardson, H. A., & Mcgrath, A. L. (2004) “Work Characteristics and Employee Health and Well-Being: Test of a Model of Healthy Work Organization”, *Journal of occupational and organizational psychology*, 77(4): 565-588.

THE RELATIONSHIP BETWEEN INTRAPRENEURSHIP AND CHANGE MANAGEMENT

Dr. Bülent GÜVEN*

ABSTRACT

Intrapreneurship, which represents entrepreneurial activity within an existing enterprise, is a means of sustaining businesses' activities in a highly competitive environment. Certain mechanisms are necessary to support and sustain the development of entrepreneurship spirit within the organization. An organization that wants a creative and innovative workforce that will be appropriate to develop and change the organization in this respect. The aim of this research is to determine the relationship between intrapreneurship and change management. In accordance with this purpose, determining the level of intrapreneurship in the enterprises and determining the level of organizational change constitute another aim of the research. In the research, a survey was conducted with the managers (white-collar) in the textile sector. As a result of these analyzes, it is found that there is a positive relationship between intrapreneurship and organizational change. In addition to that the perception of organizational change of employees increases, the intrapreneur behavior increases.

Key Words: *Intrapreneurship, Entrepreneurship, Change, Organizational Change.*

Jel Classifications: *M10, M14, M19, L26.*

İÇGİRİŞİMCİLİK VE DEĞİŞİM YÖNETİMİ İLİŞKİSİ

ÖZET

Mevcut bir işletme içerisinde girişimcilik faaliyetlerini ifade eden içgirişimcilik, şiddetli rekabet ortamında işletmelerin faaliyetlerini sağlıklı bir şekilde sürdürmelerinin bir vasıtasıdır. Örgüt içerisinde girişimcilik ruhu oluşabilmesi için onu destekleyen ve sürekli gelişmesini sağlayan belli başlı mekanizmalar gereklidir. Yaratıcı ve yenilikçi bir işgücüne sahip olmayı amaçlayan bir örgütün öncelikle örgütün bu yönde geliştirilmesi ve değiştirilmesi uygun olacaktır. Bu araştırmanın amacı içgirişimcilik anlayışı ile değişim yönetimi arasındaki ilişkiyi belirlemektir. Bu amaç doğrultusunda işletmelerdeki iç girişimcilik düzeyini belirlemek ve örgütsel değişim düzeyini belirlemek araştırmanın diğer bir amacını oluşturmaktadır. Demografik değişkenler açısından içgirişimcilik ve örgütsel değişim düzeylerindeki farklılığı belirlemek de çalışmanın amaçları arasındadır. Çalışmanın amacı

* Özel Sektör, Araştırmacı-Yazar, e-mail: guvenbul@gmail.com; Orcid No: 0000-0003-0321-9414

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES**

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

doğrultusunda veri toplamak amacıyla anket uygulanmıştır. Araştırma da tekstil sektöründe faaliyet gösteren bir fabrika da yönetici(beyaz yakalı) pozisyonunda çalışanlarla anket yapılmıştır. Yapılan analizler sonucunda içgirişimcilik ile örgütsel değişim arasında pozitif ilişkilerin olduğu tespit edilmiştir. Ayrıca Çalışanların örgütsel değişim algısı yükseldikçe içgirişimcilik davranışı arttığı ortaya çıkmıştır

Anahtar Kelimeler: İçgirişimcilik, , Girişimcilik, Değişim, Örgütsel Değişim.

Jel Classifications: M10, M14, M1,L26.

1.INTRODUCTION

In today's world, where resistance to change has become impossible, to gain sustainable competitive advantage in the global competitive environment, intrapreneurship activities, in which employees are encouraged, have become more and more important in order to reach the targeted business performance and organizational goals. Today's organizations are looking for different solutions in order to be able to sustain their economic lives, extend their life span in the competitive and dynamic business environment conditions. The ability of businesses to maintain their competitive edge, success, and even ability to sustain their activities, depends on being proactive, taking risks, and innovating in terms of product, market and technology.

For the organizations, it is important to capture the change in terms of effectiveness of the system and even to make constant change part of its reality. Growing up to the pace of change for organizations, the concept of intrapreneurship is important for employees in terms of issues such as taking risks, being competitive, aggressive, and autonomous.

Technological changes in the customer's needs and demands affect the organizations and their structures. Changes make the field of activity more complex and push organizations to innovate by forcing them to venture. The basic ability that organizations need to have in order to adapt and respond to change is the ability to differentiate in product and service fields and evaluate new opportunities. The organization can maintain its position and even be successful in the economic system as long as it is unusual.

An organization that is devoid of organizational and intrapreneur skills cannot adapt to change. Intrapreneurship is a necessary path to achieve desired change and opportunities by achieving sustainable competitive advantage. In order to provide active competitive advantage for organizations that are not able to meet the customer needs and demands of the markets that are shrinking under dynamic competition conditions and existing products and services, it is of great importance that

***ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES***

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

different strategies are introduced in the name of intrapreneurship in product, service and process management. The emergence of new chances and opportunities that appear within the organization as new services and products, and keep pace with change, gives the organizations a competitive edge.

Organizations with the highest levels of intrapreneurship move towards customer-oriented innovations that can adapt to change and teamwork. It is crucial for the success of the organization to provide support to employees by providing a workable environment for the employees who have the spirit of intrapreneurship in the organization. Intrapreneurship can only be achieved by encouraging employees with an innovative attitude to be able to develop to the desired level. An efficient and dynamic organizational change management within the organization is inevitable in order for the intrapreneurship to reach the desired level and emergence of new intrapreneurs.

The aim of this research is to reveal the relationship between change management and intrapreneurship. In this study, the information obtained on the axis of the literature review will be put into a conceptual framework and the empirical research will shed light on the practicality of the theoretical information. Despite the fact that change and entrepreneurship are interrelated issues in the theoretical framework it needs to be supported by empirical studies. In line with this purpose, a factory operating in the textile sector operating in the province of Malatya has been selected in the survey. The demographic findings will be explained. The hypotheses about change management and intrapreneurship will be tested. Finally, the evaluation and conclusion will be the last part of the study.

2. INTRAPRENEURSHIP

Entrepreneurship is a term generally used in an individual sense. However, for businesses, it has become a matter of importance for employees to contribute to innovation, service and product development. In 1983, Giffort Pinchot described intrapreneurship as a concept related to a group instead of individuals within the organization (Hisrich and Peters, 1995: 15). Intrapreneurship is defined as entrepreneurship within the existing business structure of organizations (Müftüoğlu et al., 2005: 65). Intrapreneurship focuses on innovations that are visible or emerging creativity of employees in business in issues like motivation, skills and experience in gathering resources, innovation, creativity, and risk taking (Öktem et al., 2003); 173). Intrapreneurship, also referred to as company entrepreneurship, aims to activate or reinvigorate the existing organization through risk taking, innovation and active competition behaviors (Zahra and Covin, 1995: 44).

Intrapreneurs are creative individuals who have an entrepreneurial spirit within the organization, who can see and capture the opportunity to innovate, but in the meantime transform these ideas and models into real activities that will increase the profitability and competitive power of the business they

are in (Morris and Kuratko, 2002: 85). Intrapreneurs are those who bring creative and new solutions to the problems encountered by firms (Antoncic and Hisrich, 2000: 22). Intrapreneur, revives and sustains his or her entrepreneurial talent and introduces new opportunities in the present enterprise (Top, 2006: 9). Intrapreneurs develop new investments, inventions, ideas and behaviors and employ these innovations in products, services, management programs, new plans and programs (Naktiyok, 2004: 64).

Rapidly increasing global competition, inadequacy of traditional business methods, loss of talented personnel, and issues like productivity and efficiency has increased the importance of intrapreneurship (Başar and Tosunoglu, 2006: 126). Through intrapreneurship activities of motivating business owners and employees, supporting their creativity; it is possible to increase the performance of the business with innovation activities and to provide a competitive edge (Güner ve Serinkan, 2017: 494). Organizations that do not attach importance to intrapreneurship is likely to face problems such as stagnation, loss of personnel and decline (Kuratko and Hodges, 1998: 55-56)

The Dimensions of Intrapreneurship: Researchers have studied intrapreneurship and its peculiar characteristics in different models and dimensions. As shown in Table 1, intrapreneurship consists of seven dimensions:

Table 1. The Dimensions of Intrapreneurship

| | | |
|---------------------------|--|---|
| Renewal Period | Process of creating new products, services, processes, technologies and methods | Covin and Slevin(1991); Lumpkin and Dess(1996); Knight(1997); Antoncic and Hisrich(2001); Morris and Kuratko(2002) |
| Risk Taking | Making investment decisions and taking strategic actions in an uncertain environment to evaluate new opportunities despite the risks | Miller and Friesen(1983); Covin and Slevin(1991); Lumpkin and Dess(1996-2001); Hornsby et al.(2002); Morris and Kuratko(2002); Antoncic and Hisrich(2003) |
| Proactive Behavior | The tendency of the organization to pioneer and initiate the first venture, especially by the top management | Miller and Friesen(1983); Covin and Slevin(1991); Lumpkin and Dess(1996-2001); Knight(1997); Morris and Kuratko(2002); Antoncic and Hisrich(2003) |
| Autonomy | The independence that an individual, group or organization demonstrates an idea or vision | Zajac vd.(1991); Lumpking and Dess(1996); Culhane(2003) |
| New Venture | Creating new products, new jobs and new autonomous units or semi-autonomous firms within existing organizations | Zahra(1991, 1993, 1995); Stopford and Baden-Fuller(1994); Zahra and Covin(1995); Antoncic(2000); Antoncic and Hisrich(2001) |
| Renovation | Reformulation of purpose and strategy, redefinition of business concept, reorganization and organizational change | Guth and Ginsberg(1990); Zahra(1991, 1993); Stopford and Baden-Fuller(1994); Antoncic(2000); Antoncic and Hisrich(2001, 2003) |
| Competitiveness | Attacking aggressively against the racquet or challenging the competitors directly and intensely | Covin and Covin(1990); Lumpkin and Dess(1996); Antoncic(2000); Antoncic and Hisrich(2003) |

Source: Ağca and Kurt, 2007: 92

3. ORGANIZATIONAL CHANGE

With the impact of economic, technological and social developments, organizations are constantly and rapidly changing and it becomes increasingly difficult to keep pace up with this change. Changing environmental conditions necessitate an effective and strategic management. It is important for the future of the organizations to capture the change and to consider how the organizations can influence it.

If the targeted results are not reached in the organizations and if the organization loses its organizational value and weakens, the change within the organization is inevitable. The most important reason for this change in terms of private sector enterprises is the intense competition environment (Eren et al. 2003: 59). Moreover, changes in the organization may be needed to protect the organization against changes in the outside environment or to provide development (Halis, 2001: 120). Sadler (1999) lists organizational change objectives as flexibility, changing or restructuring the organizational system, building learning organizations, supporting organizational change and development, and achieving the ideal and individual organizational wages (Dolaşır, 2005: 12).

Change implies the emergence of new concepts, and development implies that these innovations are positive (Yıldırım, 1998: 122). Schein (2009: 134) stated that the organizational change will be occur in two ways: "the general evolution" if all departments and members within the organization participates in the process and uses "specific evolution" only when a specific change is made to a particular area in a certain area. According to this definition, it can be inferred that the process of organizational change constitutes an important step in determining what will be changed in that business, how much of it will be changed, how the change in the internal environment will be met and the roadmap to be followed. Businesses are trying to understand, develop, or change the basic values, behaviors and attitudes and organization of the workplace in order to realize the causes of existence such as increasing profit and market share, increasing production and capacity (Murat ve Açıkgöz, 2007: 1).

It is impossible to resist change in dynamic structured organizations whose external environment is constantly changing (Genç, 1993: 306). When the change is examined in the organizational dimension; a system, a process or an environment in an unplanned way can be expressed as a transition from an existing state to another (Durna, 2002: 9). On the other hand, making the appropriate decisions requires rapid and consistent action (Genç, 1994: 379). Therefore, for the organization to change, making the organization ready and willing as a whole will enable both the planned change to be efficient and to be done in a shorter time. The organizational change aimed at a planned change can be regarded as the preparations for restructuring the organization against some important changes that affect its

organizational resources such as new competitors, technological changes and leadership styles (İnançoğlu, 2002: 147).

Accepting change within an organization with a strong culture structure and based on a long history is a challenging process. First of all, the key point of the change process is that the members of the organization should see it as a necessity. Also they have to understand if the change does not occur, the continuity of the organization will be jeopardized and will not be successful in the market. The reasons for the failure of organizational change are that the factors require change are not well defined; a good and strong strategic planning has not been done; there is a lack of continuity of exchange activities or they remain as a short term enthusiasm, and there is a lack of active role of members of the organization in this process (Dolaşır, 2005: 15). While a hierarchy based on a strong culture in a stable environment is adequate in change, organizations should be open to innovative and risky activities in a cultural change where there is a dynamic and uncertain environment (Halis, 2001: 119).

4. RELATIONSHIP BETWEEN CHANGE MANAGEMENT AND INTRAPRENEURSHIP

Competitive global economy causes great changes in organizations. These changes need to be carefully re-formulated while the concept of intrapreneurship that leads them to success and gains a sustainable competitive advantage should be taken into consideration. Firms are trying to find a dynamic balance point between the dilemmas of control, freedom of movement, change and continuity in order to make the entrepreneurship important and internalize within the organization (Şeşen, 2010: 35). The intrapreneurship represents efforts that tries to find a way out of the tradition and to change the strategy and organizational structure by risk taking, efficacy and aggressive posture (Demirci, 2006: 51-52). Entrepreneurship allows organizations to maintain their dynamism and change in a positive sense, to increase their capacity, to create resources, to improve their performances, to avoid downturns by avoiding stagnation and defeating inertia, and to maintain dynamism and change and to sustain their activities in internal and external markets in a healthy manner (Onay and Cavusoglu, 2010: 59).

The uncertainty and dynamism of the environment may support or hamper organizations' initiative tendency (Naktiyok and Kök, 2006: 83). Organizations operating in a dynamic environment often try to be successful by creating effective and proactive capitalist strategies for changes in their sectors. The changes in the competition and the technological developments that cause those changes are the factors that affect the density of the of intrapreneurship activities (Demirci, 2006: 77). Ross (1987) has argued that enterprises with a spirit of intrapreneurship will have more effective and longer life, whatever the size of organization is, when compared to the enterprises that fail to take the necessary steps in change and innovation (Şeşen, 2010: 36).

The main purpose of intrapreneurship is to create a dynamic, flexible and competitive organizational structure and culture that can cope with high market dynamism and competitiveness (Büte, 2008: 528). By adopting the activities of intrapreneurship, the organizational structure that does not provide benefit will be abandoned or the restructure of the organization will be reinstated. The organization structure which will be more innovative and serving the purposes by better understanding the change process.

5.EMPIRICAL RESEARCH ON CHANGE MANAGEMENT AND INTRAPRENEURSHIP

The aim of this research is to reveal the relationship between change management and intrapreneurship. In other words, the emergence of behavior of intrapreneurship will be analyzed in the context of change. In line with this purpose, an enterprise in textile sector operating in the province of Malatya has been selected in the survey. The participants are in managerial positions (white-collar). A questionnaire was applied in order to collect data in line with the aims of the study. The number of executives (white-collar) employed is 65. The questionnaires were used in the study. The questionnaires developed by Serinkan and Arat (2013: 161-163), which is used in the research of change management and intrapreneurship scale, was developed from various studies. The sample size to be selected was calculated as 56 (The Survey System, 2018) with a 5% margin of error within 95% reliability limits of the research universe. A total of 70 questionnaires were distributed randomly, in consideration of the fact that some participants would not respond with complete or correct answers. However, 54 of the questionnaires answered and returned. The return rate is 90%.

In this study, the answers to the questionnaire related to intapreneurship were as follows; reliability questionnaire for the 29 questions with 5 likert scale; Cronbach Alpha reliability coefficient was 0.966. The reliability analysis for change management were calculated as 0.977 (Cronbach Alpha Value) for the 33 questions with the likert scale of 5. According to these datas, both scales are highly reliable. The following hypotheses have been developed to explore the relationship between change management and internal entrepreneurship, and the degree level of this relationship.

H1: There is a meaningful and positive relationship between change management and intrapreneurship and their dimensions.

H2: Effective change management affects intrapreneurship positively.

5.1. Findings Related to the Research

In terms of demographic variables, determining the level of intrapreneurship and organizational change is also among the aims of the study. In line with the demographic information given in Table 2,

most of the intrapreneurs working at the firm are between the age range of 36-45 years, and the ratio of undergraduate is 65%. The majority of the intrapreneurs are working in the same business for a long period of time. 89% of the intrapreneurs working in the business stated that the organizational structure has changed.

Table 2. Demographic Findings

| Gender | N | % | Educational Status | N | % |
|---|----------|----------|--|----------|----------|
| Male | 41 | 75,9 | High- School | 9 | 16,7 |
| Female | 13 | 24,1 | Undergraduate | 35 | 64,9 |
| | | | Graduate | 9 | 16,7 |
| | | | Doctorate | 1 | 1,9 |
| Ages | N | % | Time Spent in the Organization | N | % |
| 18-25 years | 4 | 7,4 | Less than 1 year | 5 | 9,3 |
| 26-35 years | 15 | 28,8 | 1-3 years | 8 | 14,8 |
| 36-45 years | 26 | 48,1 | 4-6 years | 4 | 7,4 |
| 46-55 years | 9 | 16,7 | 7-9 years | 3 | 5,6 |
| | | | 10 years and above | 34 | 63,0 |
| Change in the Organization | N | % | ...workplace she /he is working | N | % |
| Organization completely changed | 2 | 3,7 | 1. | 23 | 42,6 |
| A major change took place in the organization | 46 | 85,2 | 2. | 18 | 33,3 |
| I am indecisive | 3 | 5,6 | 3. | 12 | 22,2 |
| No major change in business | 2 | 3,7 | 4. | 1 | 1,9 |
| No change took place in the organization | 1 | 1,9 | | | |

As given in Table 3, the arithmetic average of organizational change is 3.93 and intrapreneurship is 3.88. These values reveal that organizational change and intrapreneurship activities exist intensively in the enterprises among participating intrapreneurs.

Table 3. Standard Deviation and Average Values of Organizational Change and Intrapreneurship

| | Number of Questions | Average | Standard Deviation |
|------------------------------|----------------------------|----------------|---------------------------|
| Intrapreneurship | 29 | 3,8831 | 0,62424 |
| Organizational Change | 33 | 3,9282 | 0,70051 |

5.2. Findings Related to Hypothesis

As seen in table 5, as a result of the Pearson correlation analysis, there is a significant positive correlation between organizational change and intrapreneurship scale ($r = 0,766$, $p < 0,05$). In addition, significant positive correlations were found between organizational change and all dimensions of intrapreneurship scale ($p < 0,05$). If the results in Table 5 are noted, there is a high positive correlation between organizational change and intrapreneurship and its seven dimensions, and a moderately positive

relationship with risk taking and competitive assertiveness dimensions can be observed. The H1 hypothesis has been accepted.

Table 5. Correlation Analysis between Intrapreneurship Dimensions and Change Management

| | Organizational Change | Intrapreneurship | New Venture | Autonomy | Competitiveness | Proactive Behavior | Innovation Tendency | Innovation | Risk Taking |
|-------------------------------------|-----------------------|------------------|-------------|----------|-----------------|--------------------|---------------------|------------|-------------|
| Organizational Change | 1 | | | | | | | | |
| Intrapreneurship | 0,766 | 1 | | | | | | | |
| New Venture | 0,667 | 0,944 | 1 | | | | | | |
| Autonomy | 0,727 | 0,901 | 0,794 | 1 | | | | | |
| Competitive Entrepreneurship | 0,630 | 0,799 | 0,741 | 0,652 | 1 | | | | |
| Proactive Behavior | 0,734 | 0,894 | 0,807 | 0,795 | 0,629 | 1 | | | |
| Renewal Period | 0,716 | 0,924 | 0,832 | 0,858 | 0,664 | 0,823 | 1 | | |
| Renovation | 0,780 | 0,864 | 0,760 | 0,775 | 0,590 | 0,832 | 0,811 | 1 | |
| Risk Taking | 0,458 | 0,761 | 0,708 | 0,661 | 0,608 | 0,540 | 0,649 | 0,571 | 1 |

In the light of information presented in Table 4, the organizational change reveals 58.7% of the intrapreneur behavior. As the perception of organizational change of employees increases, the intrapreneur behavior increases. The H2 hypothesis was accepted in the direction of the results in the table.

Table 4. The Regression Analysis of Organizational Change and Intrapreneurship

| Independent Variables | B Value | T | P |
|-------------------------------------|----------------|----------------|----------------------------------|
| Stable Organizational Change | 1,202 0,683 | 3,793 8,592 | 0,000** 0,000** |
| Straight. R ² | 0,587 | | |
| F | 73,828 | | |
| P | 0,000* | | |
| Durbin-Watson | 2,229 | | |

6. CONCLUSION

Intrapreneurship and organizational change are important issues for businesses. Because of its significance, those two issues were discussed in this research. Despite the fact that change and entrepreneurship are interrelated issues in the theoretical framework it needs to be supported by empirical studies. In this study, the information obtained on the axis of the literature review will be put into a conceptual framework and the empirical research will shed light on the practicality of the theoretical information. It turns out that in the research conducted, there is a strict and positive relationship between intrapreneurship and change management. It has been observed that the success of the business is due to its continuous change and its preoccupation with intrapreneurship.

The phenomenon of intrapreneurship has emerged as a response to the rapidly developing market structures and competitive products of the globalizing world. Growing of organizations, opening up to new markets, turning opportunities and possibilities into new products and services make the issue of intrapreneurship more important in terms of organizations. There is a positive relationship between change in organizational structure and intrapreneurship in order for organizations to grow and achieve their organizational goals.

Intrapreneurship topic affecting the goals and objectives of enterprises is influenced by certain factors in an environment where knowledge and technology develop, the complexity and acceleration of change. Where the changes are expressed and the change is a rule, businesses are forced to take an opportunity and avoid threats from these environments, depending on their wishes and desires for change. Organizations can not achieve the targeted results, and if the organization loses organizational value, it is inevitable to change within the organization. Change in the organizational system is a long time process. The change, internalization and development of members' behavior, values and attitudes is a long-term process. While tangible elements of organization can change in a short time, the change of tangible aspects may require a long process.

For further development of intrapreneurship, it is necessary to provide employees with an innovative work environment. To increase market value, organizations should focus on specific changes in organizational structure in order to reshape the structure of intrapreneurship thinking. The organizational change process must be well planned and well managed. The acceptance of the principle of openness, continuous change and development within the enterprise are important. Establishment of an institutional structure in the organization that promotes intrapreneurship and provides certain changes will be effective in the professional management of this change process.

It is not so easy to see organizational change in large businesses with a long history. For instance, in terms of intrapreneurship, if a business is involved in business relationship with a company that has never been in a new market, a new business, or an organization with a system that is different from itself, then this enterprise will inevitably experience a change as a result of the relationship between them.

The fact that intrapreneurs play an active role in change will facilitate and shorten the process. The transition phase of intrapreneurship would not be complete without internalization. Internalization, on the other hand, is a phase that is not easy at all, it is even spreadable over the years, and may even result in failure. Moreover, all departments of the organization in change management should work in a coordination. Also, all departments should be open to communication, act in a responsible manner, and believe that change is both useful and necessary for both themselves and their enterprise. If an employee does not exhibit the desired behavior of change; yet shows an attitude that would cause conflict, other employees should intervene by putting psychological pressure on their friends for the success of change. Because of the damage they cause to the team spirit; employers must apply a variety of sanctions.

REFERENCES

- Ağca V. ve Yörük D. (2006) “Bağımsız Girişimcilik ve İç Girişimcilik Arasındaki Farklar: Kavramsal Bir Çerçeve”, Afyon Kocatepe Üniversitesi İ.İ.B.F. Dergisi, 8(2): 155-173.
- Antoncic, B. (2000) “Intrapreneurship: Construct Refinement and An Integrative Model Development”, Unpublished Thesis for The Degree of Doctor of Philosophy, Department of Marketing and Policy Studies Weatherhead School of Management, Case Western Reserve University, Cleveland.
- Antoncic, B. and Hisrich, R.D. (2000) “Intrapreneurship Modeling in Transition Economies: A Comparison of Slovenia and the United States”, Journal of Developmental Entrepreneurship, 5(1):21-40.
- Antoncic, B. ve Hisrich, R.D. (2001) “Intrapreneurship: Construct Refinement And Cross-Cultural Validation”, Journal of Business Venturing, 16: 497-527.
- Antoncic, B., and Hisrich, R.D. (2003) “Clarifying The Intrapreneurship Concept”, Journal of Small Business and Enterprise Development, 10 (1): 7-24.
- Başar, M. ve Tosunoğlu, T.(2006) “Değer Yaratımında İç Girişimciliğin Değişen Boyutu: Bilgi Girişimcilerinin Rolü”, Girişimcilik ve Kalkınma Dergisi, 1(1):123-136
- Büte, M. (7- 10 Mayıs 2008) “İç Girişimciliğe Verilen Önem Düzeyi ve Çevresel Faktörlerin İç Girişimcilik Üzerine Etkileri”, Kırgızistan-Türkiye Manas Üniversitesi 2. Uluslararası Girişimcilik Kongresi, Bişkek: 528-535.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Covin, J.G., and Slevin, D.P. (1989) "Strategic Management of Small Firm in Hostile and Benign Environments", *Strategic Management Journal*, 10 (1): 75-87.
- Covin, J.G. and Covin, T.J. (1990) "Competitive Agressiveness, Environmental Context, and Small Firm Performance", *Entrepreneurship Theory and Practice*,14 (4): 35-50
- Covin, J.G., and Slevin, D.P.; (1991) "A Conceptual Model of Entrepreneurship As Firm Behavior", *Entrepreneurship Theory and Practice*, 16 (1):7-25.
- Culhane, J. H. (2003) "The Entrepreneurial Orientation-Performance Linkage in High Technology Firms: An International Comparative Study", Unpublished Thesis for The Degree of Doctor of Philosophy, Graduate School of The University of Massachusetts Amherst, Amherst.
- Demirci, A. E. (2006) "İşletmelerin Yenilik Faaliyetlerinde Şirket İçi Girişimciliğin Temel Faktör Olarak İncelenmesi: Türkiye ve Polonya'da Faaliyet Gösteren Büyük Ölçekli Kimya-İlaç Sektörü İşletmelerinde Karşılaştırmalı Durum Değerlendirmesi", Basılmamış Doktora tezi, Anadolu Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Eskişehir.
- Dolaşır, S. (2005) "Değişim Yönetimi ve Spor Örgütleri", *Sportmetre Beden Eğitimi ve Spor Bilimleri Dergisi*", 3(1):11-15.
- Durna, U. (2002) "Yenilik Yönetimi", Ankara: Nobel Yayın Dağıtım.
- Eren, E., Alpkın L., ve Ergün, E. (2003) "Kültürel Boyutlar Olarak İşletmelerde İçsel Bütünleşme ve Dışsal Odaklanma Düzeylerinin Performansa Etkileri".*Doğuş Üniversitesi Dergisi*, 4(1). 55-56.
- Genç, N. (1993) "Örgütsel Kültürün Oluşumu ve Örgütsel Davranışlar Üzerine Etkisi". *Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi*, 10(1-2). 306-316.
- Genç, N.(1994)" Örgütsel Davranış, Karar Süreci ve Karşılıklı Etkileşim".*Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 10(3-4): 379-383.
- Guth, W. D. and Ginsberg, A. (1990) "Guest Editors' Introduction: Corporate Entrepreneurship", *Strategic Management Journal*, 11 (5):5-15.
- Güner, F. Ve Serinkan, C. (2017) "İç Girişimcilik ve Yenilik İlişkisi: Banka Çalışanları Üzerinde Bir Araştırma" *Mehmet Akif Ersoy Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 9(22) :482-499.
- Gürbüz S.,Bekmezci M., Mert İ. S. (2010) "Örgütsel Faktörlerin İç Girişimciliğe Etkisi: İş Tatmini Aracı Değişken mi?", *Organizasyon ve Yönetim Bilimleri Dergisi*, 2(2):127-135.
- Halis, M. (2001) "Durumsallığı Açısından Türk Örgüt Kültürlerindeki Yönelimler – Ampirik Bir Çalışma", *Yüzüncü Yıl Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 2:109-135.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Hisrich, R. D. and Peters, M. P. (1995) "Entrepreneurship-Starting, Developing, and Managing a New Enterprise" (Third Edition), Chicago: Irwin Publishing.
- Hornsby J.S., Kuratko D.F. and Zahra, S.A. (2002) "Middle Managers' Perception of The Internal Environment For Corporate Entrepreneurship: Assessing A Measurement Scale", *Journal of Business Venturing*, 17 (3):253-273.
- İnançoğlu, E. (2002) "Çalışma Değerlerinin Örgütsel Değişime Dirence Etkisi", 10. Ulusal Yönetim ve Organizasyon Kongresi, Antalya, s. 142-158.
- Knight, G. (1997) "Cross-Cultural Reliability and Validity of A Scale To Measure Firm Entrepreneurial Orientation", *Journal of Business Venturing*, 12 (3):213-225
- Koçel, T. (1998) "Girişimcilik Ama Hangisi?", *Executive Excellence*, 10:17-18
- Kuratko D.F., Montagno R.V., and Hornsby J.S. (1990) "Developing An Intrapreneurial Assessment Instrument for Effective Corporate Entrepreneurial Environment", *Strategic Management Journal*, 11(5):49-58.
- Kuratko D.F., Hornsby J.S., Naffziger D.W. and Montagno R.V. (1993) "Implement Entrepreneurial Thinking in Established Organizations", *SAM Advanced Management Journal*, 58 (1): 28- 39.
- Kuratko, D. F. and Welsch, H. P. (1994) "Entrepreneurial Strategy Text and Cases" , Fort Worth, TX: The Dryden Press.
- Kuratko, F. D. and Hodgetts, M. R. (1998) "Entrepreneurship", Orlando, Florida: The Dreyden Press.
- Kuratko F.K.,Hornsby J.S., and Sabatine F.J. (1999), *The Breakthrough Experience: A Guide to Corporate Entrepreneurship*, Midwest Entrepreneurial Education Center, College of Business Ball State University.
- Kuratko, D. F. and Hodgetts, R. M. (2001), *Entrepreneurship: A Contemporary Approach*, South-Western Thomson Learning: Mason, Ohio.
- Lumpkin, G.T. and Dess, G.G. (1996) "Clarifying The Entrepreneurial Orientation Construct and Linking It To Performance", *Academy of Management Review*, 21 (1):135-172.
- Lumpkin, G.T. and Dess, G.G. (2001), "Linking Two Dimensions of Entrepreneurial Orientation to Firm Performance: The Moderating Role of Environment and Industry Life Cycle", *Journal of Business Venturing*, 16 (5):429-451.
- Miller, D., and Friesen, P.H. (1983) "Strategy-Making and Environment: The Third Link", *Strategic Management Journal*, 4 (3):221-235.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Morris, M. H. and Kuratko, D. F. (2002) "Corporate Entrepreneurship: Entrepreneurial Development within Organizations", Orlando, Florida: Harcourt College Publishers
- Murat, G. ve Açıkgöz, B.(2007) "Yöneticilerin Örgüt Kültürü Algılamalarına İlişkin Bir Analiz: Zonguldak Karaelmas Üniversitesi", Zonguldak Karaelmas Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 3(5):1-20.
- Müftüoğlu T., Ürper Y., Başar M., Tosunoğlu, T.(2005) "Girişimcilik", Anadolu Üniversitesi Yayınları(Yayın No:1567), Eskişehir.
- Naktiyok A.(2004) "İç Girişimcilik", 1. Baskı, İstanbul: Beta Yayınları.
- Naktiyok, A. ve Bayrak Kök, S. (2006)"Çevresel Faktörlerin İç Girişimcilik Üzerine Etkileri", Afyon Kocatepe Üniversitesi İ.İ.B.F. Dergisi , 8(2):77-96
- Öktem M.K., Leblebici D.N., Arslan M., Kılıç M. ve Aydın, M.D. (2003)," Girişimci Örgütsel Kültür ve Çalışanların İç Girişimcilik Düzeyi: Uygulamalı Bir Çalışma", Hacettepe Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 21(1), 169-188
- Ross, J. E.(1987). "Intrapreneurship and Corporate Culture", Industrial Management: 22-28
- Schein, E.H. (2009) "The Corporate Culture: Survival Guide", San Francisco: Jossey-Bass Publishers.
- Sharma P. ve Chrisman J. J. (1999) "Toward A Reconciliation of the Definitional Issues in the Field of Corporate Entrepreneurship", Entrepreneurship Theory and Practice, 23(3):11-27.
- Serinkan, C. ve Arat, G.(2013) İşletmelerde Örgütsel Değişim ve İç Girişimcilik. Beta Basım: İstanbul.
- Stopford, J.M. and Baden-fuller, C.W.F. (1994), "Creating Corporate Entrepreneurship", Strategic Management Journal, 15 (7): 521- 536.
- Şeşen, H. (2010) " Öncülleri ve Sonuçları ile Örgüt İçi Girişimcilik: Türk Savunma Sanayinde Bir Araştırma", Yayımlanmamış Doktora Tezi, Kara Harp Okulu Savunma Bilimleri Enstitüsü Savunma Yönetimi Ana Bilim Dalı, Ankara.
- The Survey System(2018) "Sample Size Calculator", <http://www.surveysystem.com/sscalc.htm>, (12.07. 2018).
- Top, S. (2006) "Girişimcilik-Kesif Süreci", İstanbul: Beta Yayınları.
- Zahra, S.A (1991) "Predictors and Financial Outcomes of Corporate Entrepreneurship: An Exploratory Study", Journal of Business Venturing, 6 (4):259-285.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Zahra, S.A. (1993) "Environment, Corporate Entrepreneurship, and Financial Performance: A Taxonomic Approach", *Journal of Business Venturing*, 8 (4):319-340.
- Zahra, S. A. (1995) "Corporate Entrepreneurship and Financial Performance: The Case of Management Leveraged Buyouts", *Journal of Business Venturing*, 10 (3):225-247.
- Zahra, S.A. and Covin, J.G.(1995) "Contextual Influences on The Corporate Entrepreneurship Performance Relationship: A Longitudinal Analysis", *Journal of Business Venturing*, 10 (1):43-58.
- Zajac E.J., Golden B.R., and Shortell S.M. (1991) "New Organizational Forms For Enhancing Innovation: The Case of Internal Corporate Joint Ventures", *Management Science*, 37 (2):170-1
- Zahra, S.A. (1993), "Environment, Corporate Entrepreneurship, and Financial Performance: A Taxonomic Approach", *Journal of Business Venturing*, 8 (4):319-340.
- Zahra, S. A. (1995) "Corporate Entrepreneurship and Financial Performance: The Case of Management Leveraged Buyouts", *Journal of Business Venturing*, 10 (3):225-247.
- Zahra, S.A. and Covin, J.G.(1995) "Contextual Influences on The Corporate Entrepreneurship Performance Relationship: A Longitudinal Analysis", *Journal of Business Venturing*, 10 (1):43-58.
- Zajac E.J., Golden B.R., and Shortell S.M. (1991) "New Organizational Forms For Enhancing Innovation: The Case of Internal Corporate Joint Ventures", *Management Science*, 37 (2):170-1
- Yıldırım, R. (1998) "Yaratıcılık ve Yenilik", (5.Basım), Sistem Yayıncılık:İstanbul.

**COULD ECONOMIC GROWTH BE A SOLUTION TO ENVIRONMENTAL POLLUTION?
NEW EVIDENCE FROM A PANEL SMOOTH TRANSITION REGRESSION MODEL¹**

Celil AYDIN*

Ömer ESEN**

ABSTRACT

This paper examines whether economic growth naturally leads to improvements in environmental quality as often referred to in political and academic platforms. Using a panel data set of 65 net energy-importing countries, we employ the recently developed panel smooth transition regression (PSTR) model to test validity of the environmental Kuznets curve (EKC) hypothesis, using a dataset of carbon dioxide (CO₂) emission per capita and GDP per capita between 1971 and 2014. The empirical results indicate that the nonlinear relationship between CO₂ emissions and income does not exhibit the inverted U-shape pattern associated with the EKC hypothesis. The turning points are US\$8,655 and US\$50,970, which the PSTR model endogenously determines. Accordingly, along with an increase in GDP per capita, CO₂ emission increases initially, and after reaching certain per capita income levels, CO₂ does not decline with further growth, but the pollution growth rate slows smoothly. Thus, a strong substitutive relationship between income and CO₂ emissions can most clearly not be found for the 65 net energy-importing countries providing evidence in favor of the EKC hypothesis in the development process of countries.

Keywords: *Kuznets Curve, Carbon Dioxide Emission, Panel Smooth Transition Regression*

1. INTRODUCTION

Since coming into existence, human beings have used the environment and natural resources in line with their needs. Along with this process, the dimension of the damage caused by man-made pollution increases with each passing day. Global warming, the disruption of biological balance, and environmental pollution seen around the world have decreased the quality of life and reached an extent that threatens human health. Countries targeting a high welfare level increasingly need more energy—the main input of especially social and economic development—which brings to the forefront the

¹ This work was supported by Scientific Research Projects Coordination Unit of Bandırma Onyedi Eylül University. Project No: BAP-18-İİBF-1009-120

* Associate Prof., Bandırma Onyedi Eylül University, Balıkesir, Turkey caydin@bandirma.edu.tr

** Associate Prof., Namık Kemal University, Tekirdağ, Turkey omeresen81@yahoo.com

dilemma of a growth-environment. The concept of “the limits to growth,” implying that environmental degradations will increase in parallel to economic growth, created considerable repercussions in academia in the 1970s and turned into an effective paradigm. Since then, several studies have sought to determine how sustainable growth can be achieved by investigating how the growth that countries need can be achieved in harmony with the environment, without decreasing humans’ quality of life.

In recent years, the extension of this argument has been expressed on the basis of the environmental Kuznets curve (EKC). The hypothesis that environmental growth and pollution increase at the first stage of economic growth process, but improvements in the environmental conditions are achieved after surpassing a certain income threshold is referred to as the EKC in the literature. The pioneering studies on such a relationship between environmental degradation and income were carried out by Grossman and Krueger (1991, 1995), Shafik and Bandyopadhyay (1992), Panayotou (1993), and Selden and Song (1994).

Accordingly, the EKC hypothesis argues that environmental degradation increases during the first stages of economic growth, but this pollution declines with the progress of growth. As agricultural production is generally carried out in underdeveloped economies, the level of environmental pollution is expected to be low in these countries. However, environmental pollution is expected to increase with the rise in production in the subsequent stages when economic growth and industrialization are achieved. When a certain threshold (income) level is reached, the production activities are expected to shift toward knowledge-intensive industries and services. Environmental consciousness, regulations about the environment, and environmental costs increase, and eco-friendly technologies are developed; thus, the environmental conditions are enhanced by reversing the process. This approach can also be seen as the course followed by developed economies. However, it is important to note that the findings on the course of developing economies are still ambiguous in the literature.

The current study focuses on a sample of net energy-importing countries from 1971 to 2014. In the empirical literature, relatively limited efforts have been made to examine the existence of a relationship between economic growth and environmental quality by considering whether countries have the energy reserves. The degree of dependence on external energy is one of the determining factors for countries’ production structure and energy consumption. The present study is expected to make a significant contribution to the literature concerning the CO₂ emission-growth nexus because the countries in the sample group investigated were determined based on their energy reserves.

The paper proceeds as follows: In the first part, the potential effects of economic growth on environmental pollution are handled, and the theoretical and empirical literature focusing on the

relationship between income and environmental quality are discussed. In the second part, the validity of the EKC approach is tested within the scope of the empirical model; the model and data set are explained first, and then the empirical findings obtained as a result of analyses and tests administered with regard to the analyses are summarized. In the last part of the study, the consistency of the findings with the existing literature is evaluated, and various recommendations about policies are offered in line with the results.

2. METHODOLOGY

In the present study, the non-linear relationship between CO₂ emission and per capita income is investigated through a non-linear panel data analysis. In order to investigate the non-linear relationship between CO₂ emissions and per capita income, a fixed PSTR model with two regimes was created based on the model used by Gonzalez et al. (2005), Fouquau et al. (2008), and Chiu (2017) in their studies, as shown on Equation (1):

$$\ln CO_{2i,t} = \mu_i + \beta_0 \ln GDP_{i,t} + \beta_1 \ln GDP_{i,t} * g(q_{i,t}; \gamma, \theta) + \varepsilon_{i,t} \quad (1)$$

where $\ln CO_2$ represents log-transformed per capita CO₂ emissions; $\ln GDP$ is log-transformed per capita real GDP; ε is the error term; $t = 1, 2, \dots, T$ time periods; and $i = 1, 2, 3, \dots, N$ countries. Coefficients μ_i allow for the possibility of unit-specific fixed effects, and the variable q_i is a potential threshold variable.

3. DATA, EMPIRICAL RESULTS, AND IMPLICATIONS

3.1. Data Specifications

This study investigated the relationship between CO₂ emissions and real income for the period using the PSTR analysis, which takes into account the per capita real GDP threshold level.³ This study used annual and balanced panel data covering 65 net energy-importing countries for the period 1971–2014 and further divided the dataset into developed and developing countries.⁴

In this study, the variables included per capita CO₂ emissions and per capita real GDP, measured in metric tons and constant 2005 US dollars, respectively. All variables come from the International Energy Agency (IEA) database and are expressed in natural logarithms.

³ Countries were divided according to the data of net energy imports from the World Development Indicator database. A negative value indicates that the country is a net energy exporter whereas a positive value means that the country is a net energy importer.

⁴ According to IMF country classification, we split our sample into two groups: developed and developing countries. Among these 65 countries, 28 countries were developed countries, while 37 countries were developing countries.

3.2. Empirical Results

In the present study, investigating the non-linear relationship between per capita CO₂ emissions and per capita income, the dependence among the cross-sections (countries) were examined in the first place. Whether the dependence among the cross-sections constituting the panel is taken into account affects the estimation results considerably (Breusch and Pagan, 1980; Pesaran, 2004). For this reason, it is necessary to test first the presence of cross-section dependence in the series and the model. According to the test statistics regarding the per capita GDP and per capita CO₂ emission series in Table 2, the null hypothesis “*there is no cross-section dependence*” was strongly rejected. It was determined that cross-sectional dependence existed in the series and the model. For this reason, the stability of the series was investigated with Moon and Perron’s (2004) second-generation panel unit root test, taking the cross-section dependence into account in the following stages of the study. According to the results, the null hypothesis “*the series include unit roots*” in developing and developed countries and the full sample was rejected for per capita GDP and per capita CO₂ emission series. This situation proves that the series were stable at level values ($I(0)$).

The next step after determining that the variables used in the model were stable at level values was to test the linear model against the non-linear model, which was the first stage of the PSTR analysis. The results of the Wald tests (LM), Fisher tests (LM_F), and LRT tests (LRT) calculated to test the linearity in developing and developed countries and the full sample and to determine the transition function number. The null hypothesis for both developing and developed countries and the full sample was rejected at the 1% significance level in line with the results of LM , LM_F , and LRT . Thus, the alternative hypothesis that the model includes at least one non-linear threshold effect in each of the three groups was accepted, and it was concluded that it would not be right to use the non-linear models in modeling the effect of per capita GDP and per capita CO₂ emissions. With the rejection of the linear model hypothesis for each of the three groups, the next stage of the analysis was to determine the regime numbers. In order to determine the convenient regime number, LM , LM_F , and LRT tests were re-administered for the full sample and developing and developed countries. The null hypothesis “*the model includes a threshold effect*” was rejected for developing countries and the full sample but not for developed countries. Thus, it was determined that the model included a threshold effect in developed countries that could be estimated using a two-regime PSTR model. On the other hand, the fact that the alternative hypothesis “*the models included at least two threshold effects*” was accepted while the null hypothesis was rejected for developing countries and the full sample requires determining the right number of regimes precisely. For this reason, the hypothesis “*the models included at least two threshold effects*” was re-tested against the null hypothesis “*the models included two threshold effects*” for

developing countries and the full sample. According to the results obtained, the null hypothesis “*the models in each of the two groups included two threshold effects*” could not be rejected. As a result, it was determined that the models in developing countries and the full sample included two threshold effects that could be estimated using the three-regime PSTR models. In the next stage, the non-linear relationship between per capita CO₂ emissions and per capita income was estimated with a two-regime PSTR model for developed countries and a three-regime PSTR model for developing countries and the full sample; the results are provided in Table 1. These results indicate that the estimated slope parameters are relatively small in all models, ranging from 0.899 to 8.956, implying that a continuum of conditions among regimes occurs—that is, the relationship between CO₂ emissions and real income smoothly switches from one regime to another.

Table 1. Estimated results of the PSTR model

| Threshold variables (<i>LnGDP</i>) | Full Sample | Developed Countries | Developing Countries |
|--------------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| <i>LnGDP</i> ₁ | 0.785*** (0.019) | 0.763*** (0.018) | 0.919*** (0.032) |
| <i>LnGDP</i> ₂ | -0.134*** (0.005) | -0.159*** (0.005) | 0.107*** (0.010) |
| <i>LnGDP</i> ₃ | -0.028*** (0.003) | | -0.076*** (0.009) |
| Location parameters, θ | 9.066 10.839 | 10.883 | 9.706 10.073 |
| Slope parameters, γ | 0.899 6.093 | 3.475 | 8.956 4.153 |

Notes: Dependent variable is per capita CO₂ emissions in natural logarithm. Standard errors are corrected for heteroskedasticity in parentheses. All variables are expressed in natural logarithm. *** indicates the 1% significance level.

As seen in Table 1, the estimated per capita GDP co-efficient (β_0) in the first regime of the models for developing and developed countries and the full sample were statistically significant and positive (0.785, 0.763, and 0.919, respectively). The coefficient that was expressed as the sum of β_0 and β_1 in the second regime was still positive (0.651, 0.604, and 1.026, respectively) and had a lower value for developed countries and the full sample compared to the first regime whereas it had a higher value in developing countries. In developing countries and the full sample with the third regime, the coefficient was expressed as the sum of β_0 , β_1 , and β_2 and had a lower (compared to the second regime) but positive value (0.623 and 0.950, respectively). The results indicate that the increase in real income for the full sample and developed countries increases CO₂ emissions while the effect of real income on CO₂

emissions declines after it reaches the first income threshold level ($\theta=9.066$, about US\$8,655.93 for the full sample; $\theta=10.883$, about US\$53,263.15 for developed countries), but still remains positive whereas the effect of real income on CO₂ emission increases in developing countries. On the other hand, the results demonstrate that the effect of real income on CO₂ emission declines in comparison to the previous regime after the increase in real income reaches the second threshold level ($\theta=10.839$, about US\$50,970.38 for full sample; $\theta=10.073$, about US\$23,694.54 for developing countries), but still remains positive for developing countries and the full sample. As a result, this situation indicates that CO₂ emissions do not decline as real income increases in all three models. Thus, the study demonstrates that the EKC hypothesis is not valid for developing and developed countries or the full sample in terms of CO₂ emissions.

4. CONCLUSION

The role of real income in the non-linear relationship between CO₂ emissions and real income and the validity of the EKC hypothesis were investigated for 65 net energy-importing countries. For this purpose, we used the PSTR model developed by Gonzalez et al. (2005) based on the model used by Faquau et al. (2008) and Chiu (2017). The findings obtained in the present study can be summarized as follows: First, the present study provides new evidence about the presence of a non-linear relationship between CO₂ emissions and per capita income in the economies in question. Second, a positive relationship exists between CO₂ emissions and per capita income. As per capita income increases, carbon dioxide emissions increase in the beginning and continue to increase after the per capita income reaches a certain level, but the rate of increase falls. The data did not indicate that high income levels are a solution to environmental pollution, as asserted by the EKC hypothesis, whereas a decline was noted in the rate of increase of the emission level with the growth in income. For this reason, the EKC hypothesis is not valid for the countries in question in terms of CO₂ emissions. Finally, the direction of the relationship between CO₂ emissions and real income does not change in developing and developed countries when the sample is divided into these two groups, and the EKC hypothesis is not valid in either of the two groups.

REFERENCES

- Breusch, T. S. and Pagan, A. R. (1980) "The Lagrange Multiplier Test and Its Applications to Model Specification in Econometrics", *The Review of Economic Studies*, 47(1): 239-253.
- Chiu, Y. B. (2017) "Carbon dioxide, Income and Energy: Evidence from a Non-Linear Model", *Energy Economics*, 61: 279-288.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Fouquau, J., Hurlin, C., and Rabaud, I. (2008) "The Feldstein–Horioka Puzzle: A Panel Smooth Transition Regression Approach", *Economic Modelling*, 25: 284–299.
- Gonzalez, A., Terasvirta, T. and van Dijk, D. (2005) "Panel Smooth Transition Regression Model and an Application to Investment Under Credit Constraint", *Working Paper in Economics and Finance*, Stockholm School of Economics, Vol. 64.
- Grossman, G. M., and Krueger, A. B. (1991) "Environmental Impacts of a North American Free Trade Agreement". NBER Working Papers, WP. No: 3914.
- Grossman, G. M., and Krueger, A. B. (1995) "Economic Growth and the Environment", *The Quarterly Journal of Economics*, 110(2): 353-377.
- Moon, H. R., and Perron, B. (2004) "Testing for a Unit Root in Panels with Dynamic Factors", *Journal of Econometrics*, 122(1): 81-126.
- Panayotou, T. (1993) "Empirical Tests and Policy Analysis of Environmental Degradation at Different Stages of Economic Development", *World Employment Programme Research Working Papers*. WP No. 238. Geneva: International Labor Office.
http://www.ilo.org/public/libdoc/ilo/1993/93B09_31_engl.pdf
- Pesaran, M. H. (2004) "General Diagnostic Tests for Cross Section Dependence in Panels", *CESifo Working No. 1229*.
- Selden, T. M., and Song, D. (1994) "Environmental Quality and Development: is there a Kuznets Curve for Air Pollution Emissions?." *Journal of Environmental Economics and Management*, 27(2): 147-162. doi:10.1006/jeem.1994.1031
- Shafik, N., and Bandyopadhyay, S. (1992) "Economic Growth and Environmental Quality: Time-Series and Cross-Country Evidence. Policy Research Working Paper Series", WP. No. 904, Washington, DC.: World Bank Publications.

**ENVIRONMENT KUZNETS CURVE FOR DEFORESTATION: NEW EVIDENCE FROM A
PANEL SMOOTH TRANSITION REGRESSION APPROACH**

Celil AYDIN*

Ömer ESEN**

ABSTRACT

Deforestation has irreversible heavy consequences, due to the benefits of forests to soil, water resources, climate, biodiversity and human health. The removal of the forests, which serve as natural carbon sludge, causes the carbon dioxide gas stored in these areas to be released to the atmosphere again and the greenhouse effect is increased. Therefore, it is of great importance to tackle deforestation as one of the most important indicators of environmental degradation.

This paper tackles whether the effect of economic development on deforestation using recently developed panel smooth transition regression (PSTR) techniques. The sample consists of BRICS-T (Brazil, Russia, India, China, South Africa and Turkey) countries, over the period 1990–2015. The findings evidence that there is a strongly non-linear link among per capita income and deforestation. As income per capita increases, deforestation tends to increase initially, and after the level of income exceeds approximately US\$8,159.18, it smoothly slows down but does not decline with further growth. This paper reveals that the relationship between income level and deforestation may depend on many factors, and therefore economic growth singly cannot solve deforestation and its consequences.

1.INTRODUCTION

The debate on whether natural resources are sufficient for sustainable economic growth started in the 1970s (Meadows et al., 1972). Environment-sustainable growth issues with globalization gained an international dimension in the 70s and 80s and for the first time, environmental problems started to be discussed on a global scale with the Stockholm Declaration adopted at the UN Conference on the Human Environment (UNCHE) in 1972 and the World Charter for Nature adopted by the UN General Assembly in 1982. The debates on the fact that population growth and increasing production and consumption appetite may not be maintained forever in a limited world are still being discussed in different platforms.

* Associate Prof., Bandırma Onyedi Eylül University, Balıkesir, Turkey caydin@bandirma.edu.tr

** Associate Prof., Namık Kemal University, Tekirdağ, Turkey omeresen81@yahoo.com

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

At this point, such steps are of great importance as international consensus and cooperation are needed to address and solve the environmental problems affecting the whole world.

The environment is included in the production process by providing the necessary raw materials and other inputs for the continuity of economic activities; however, wastes that harm the environment may be formed at the end of production and consumption processes. Some of the waste materials can be reused in producing many products or materials by recycling, but some wastes that cannot be recycled can cause permanent damage to the environment. Assuming the limited availability of natural resources, economies may choose to increase production and income for economic development as the primary target and ignore environmental problems due to the costs. Moreover, increasing international competition with globalization may increase environmental damage and even weaken economic growth dynamics in the long term.

The level of relationship between environment and economy varies according to the level of development of countries. In developed countries, which focus on environmental issues in a wide range from investment policies to technology policies, the necessary costs can be taken, and public administrations can easily demand the necessary financial sacrifice from producers and consumers and people can afford a cleaner environment, while the environment in developing countries is ignored.

Nowadays, with the increase in the environmental sensitivity of producers and consumers in the developed countries there is a significant increase in the number and sanctions of environmental regulations. Due to the strict environmental policies implemented in developed countries, the production costs of firms are increasing. However, in developing countries, the priority of economic decision-making units is to increase per capita income and economic growth. Despite the damages to the environment in these countries, it is aimed to sustain economic growth. With free global trade, the producers in the polluting industries in developed countries often prompt their activities to developing countries where environmental regulations are relatively lax, in order to avoid the costs of high environmental standards. When all these effects are combined with production-driven pollution, the final outcome could easily reverse the optimistic result that the environmental degradation may eventually solved automatically as income increases.

Forests play a critical role in the absorption of greenhouse gases that foster climate change and global warming. Less forest means more greenhouse gases are released into the atmosphere and global warming increases more rapidly. Therefore, one of the most important determinants of environmental quality is size of forest areas. Forests have significant environmental attributes, including soil conservation, climate and water regime regulation, air pollution prevention, carbon sequestration,

greenhouse gas emissions and biodiversity conservation. The forests are being cleared for mining, infrastructure or urbanization as well as for agricultural and livestock activities. This is defined as a forest conversion in the literature and is one of the leading causes of deforestation at this point. Deforestation resulting from clearing or converting forest land for other purposes poses a threat not only at the local level, but also globally. Such changes in land-use result in many irreversible losses, such as the loss of valuable habitats, soil erosion, land degradation, reduced fresh water and the release of carbon into the atmosphere. One of the biggest dilemmas of the recent times is how to increase agricultural production and ensure food safety without reducing forest areas.

Initially, the concept of deforestation is loosely used in the climate change negotiations. But then, after the understanding of the contributions of forests in the context of climate change, it was given more importance. Rio Declaration in 1992 at the UN Conference on Environment and Development (UNCED), The Kyoto Protocol in 1997, the UN's Millennium Declaration in 2000, the Hague Ministerial Declaration in 2002, and in 2005 World Summit on protection of global forests highlighted the rising concern over global deforestation (FAO, 2018). However, despite this concern, the world's forest area has declined by 1.3 million hectares between 1990 and 2015 (FAO, 2016).

In the last decade, many academic studies have been conducted to assess the effect of economic growth on environmental quality. Since there are many environmental quality criteria, various environmental degradation indicators have been used in the literature for this purpose. Some of these indicators show that environmental degradation increase at the first stage of economic growth process, but eventually reaches the peak and tends to decline after exceeding a certain level of economic development. This inverted U-shape relationship between environmental quality and economic development is usually labeled the environmental Kuznets curve (EKC hereafter), drawing on a similarity with the pattern of Kuznets (1955) on the relationship of income inequality to changes in economic development. The pioneering studies on such a relationship between economic growth and environmental quality were made by Grossman and Krueger (1991, 1995), Shafik and Bandyopadhyay (1992), Panayotou (1993), and Selden and Song (1994). Many other studies followed the path traced by these authors.

There are a large number of studies examining the empirical relationships between environmental degradation and economic growth. Based on the methodology and indicators used, the literature on the relationship between environmental quality and economic growth may be divided into several parts, such as a variety of indicators of environmental degradation (carbon dioxide emissions, sulphur dioxide emissions, exhaust emission, wastewater discharge, municipal waste and deforestation, etc.) and applying different models (linear, non-linear, pure-parametric, semi-parametric, non-parametric and

cubic). However, analyzing the literature, this study will focus on nonlinear model studies rather than linear based studies. Because, in linear analyzes, the predictor variables are transformed in ways that produce curvature to examine the nonlinear relation between the variables. For instance, a squared variable can be added to form a U-shaped curve. Although the predictor is squared, the model is still linear basically in parameters. However, such an approach may lack flexibility to detect the true shape of the relationship.

Most studies using a non-linear approach for examining the environment–development nexus have focused on pollutant emissions (Aslanidis and Xepapadeas, 2006; Fosten et al., 2012; Wang 2012; Esteve and Tamarit, 2012; Furuoka, 2015; Heidari et al., 2015; Zortuk and Çeken, 2016; Chiu, 2017; Aydin and Esen, 2017; Fernández-Amador et al., 2017). The empirical results indicate that income has a threshold effect on environmental pollution. Only a limited number of these have concentrated on resource usage such as deforestation. The few studies (Panayotou, 1993; Koop and Tole, 1999; Bhattarai and Hammig, 2001; Ehrhardt-Martinez et al., 2002; Bhattarai and Hammig, 2004; López and Galinato, 2005; Culas, 2007; Ogundari et al., 2017) on this topic question the existence of an EKC for deforestation and the majority of them use linear models.

Reviewing the literature on the EKC hypothesis for deforestation with nonlinear models, Lee et al. (2009) and Chiu (2012) can also be considered pioneering; they found the inverted U-shaped relation between deforestation and real income for 52 developing countries during the 1972–2003 period by applying the PSTR model. The findings indicate that deforestation initially increased with the increase in real income, but decreased after reaching certain income levels.

The present study investigates whether the threshold effect of economic development on the level of deforestation utilizing an innovative non-linear model – the panel smooth transition regression (PSTR) techniques of González et al. (2005). The study focuses on the existence of the EKC for BRICS-T countries, over the period 1990–2015. The remainder of the paper is organized as follows: Section 2 describes the adopted methodology and data description. Section 3 provides the empirical results, and policy implications. Lastly, Section 4 contains the conclusions.

2.METHODOLOGY AND DATA

In the present study, the non-linear relationship between deforestation and per capita income is investigated through a non-linear panel data analysis. In order to investigate the non-linear relationship between deforestation and per capita income, a fixed PSTR model with two regimes was created based on the model used by Gonzalez et al. (2005), Fouquau et al. (2008), and Chiu (2017) in their studies, as shown on Equation (1):

$$\text{LnDForest}_{i,t} = \mu_i + \beta_0 \text{LnGDP}_{i,t} + \beta_1 \text{LnGDP}_{i,t} * g(q_{i,t}; \gamma, \theta) + \varepsilon_{i,t} \quad (1)$$

where LnDForest_2 represents log-transformed the level of deforestation; LnGDP is log-transformed per capita real GDP; ε is the error term; $t = 1, 2, \dots, T$ time periods; and $i = 1, 2, 3, \dots, N$ countries. Coefficients μ_i allow for the possibility of unit-specific fixed effects, and the variable q_i is a potential threshold variable.

This study investigated the relationship between deforestation and real income for the period using the PSTR analysis, which takes into account the per capita real GDP threshold level. This study used annual and balanced panel data covering BRICS-T countries for the period 1990–2015. In this study, the variables included deforestation and per capita real GDP, measured the share of land and constant 2010 US dollars, respectively. All variables come from the World Development Indicators (WDI) database and are expressed in natural logarithms.

3. EMPIRICAL RESULTS

In the present study, investigating the non-linear relationship between deforestation and per capita income, the dependence among the cross-sections (countries) were examined in the first place. According to the test statistics regarding the per capita GDP and deforestation series, the null hypothesis “*there is no cross-section dependence*” was strongly rejected. It was determined that cross-sectional dependence existed in the series and the model. For this reason, the stability of the series was investigated with second-generation panel unit root test, taking the cross-section dependence into account in the following stages of the study. According to the results, the null hypothesis “*the series include unit roots*” in developing and developed countries and the full sample was rejected for per capita GDP and deforestation series. This situation proves that the series were stable at level values ($I(0)$).

The next step after determining that the variables used in the model were stable at level values was to test the linear model against the non-linear model, which was the first stage of the PSTR analysis. The null hypothesis was rejected at the 1% significance level in line with the results of LM , LM_F , and LRT . Thus, the alternative hypothesis that the model includes at least one non-linear threshold effect was accepted, and it was concluded that it would not be right to use the non-linear models in modeling the effect of per capita GDP and deforestation. With the rejection of the linear model hypothesis, the next stage of the analysis was to determine the regime numbers. In order to determine the convenient regime number, LM , LM_F , and LRT tests were re-administered. The null hypothesis “*the model includes a threshold effect*” was not rejected. Thus, it was determined that the model included a threshold effect that could be estimated using a two-regime PSTR model. In the next stage, the non-linear relationship between deforestation and per capita income was estimated with a two-regime PSTR model; the results

are provided in Table 1. These results indicate that the estimated slope parameters are relatively small (3.081), implying that a continuum of conditions among regimes occurs—that is, the relationship between deforestation and real income smoothly switches from one regime to another.

Table 1. Estimated results of the PSTR model (Dependent variable: *LnDForest*)

| Threshold variables (<i>LnGDP</i>) | Full Sample |
|--------------------------------------|----------------------|
| <i>LnGDP</i> ₁ | 2.133*** (0.134) |
| <i>LnGDP</i> ₂ | -0.316*** (0.041) |
| Location parameters, θ | 9.007 |
| Slope parameters, γ | 3.081 |

Notes: Standard errors are corrected for heteroskedasticity in parentheses. All variables are expressed in natural logarithm. *** indicates the 1% significance level.

As seen in Table 1, the estimated per capita GDP co-efficient (β_0) in the first regime of the model was statistically significant and positive (2.133). The coefficient that was expressed as the sum of β_0 and β_1 in the second regime was still positive (1.817) and had a lower value compared to the first regime whereas it had a higher value. The results indicate that the increase in real income increases deforestation while the effect of real income on deforestation declines after it reaches the first income threshold level ($\theta=9.007$, about US\$8,159.18), but still remains positive. As a result, this situation indicates that deforestation do not decline as real income increases in the model. Thus, the study demonstrates that the EKC hypothesis is not valid for sample in terms of deforestation.

4.CONCLUSION

It is important to learn how and why the forest area changes, in order to manage the forests and the environment in a sustainable way and to intervene early to possible environmental problems. Because such changes may lead to long-term irreversible losses such as climate change, global warming, and loss of biodiversity. As forests provide a range of ecological and environmental services, such as biodiversity conservation, forest products and water refinement, erosion control and carbon sequestration, it is vital to examine the issue of deforestation. To that aim, this paper has tackled the “deforestation–income” relationship for BRICS-T countries, over the period 1990–2015. In the paper, we apply the PSTR model, which endogenously determines the threshold level to examine whether the nonlinear effect of economic development on deforestation.

According to the result, the increase in real income increases deforestation while the effect of real income on deforestation declines after it reaches the first income threshold level ($\theta=9.007$, about US\$8,159.18), but still remains positive. This study demonstrates that the EKC hypothesis is not valid for sample in terms of deforestation.

It is expected that finding may be useful as a guide for policy makers and researchers to reduce greenhouse gas emissions and as a policy recommendation to ensure sustainable management of forests in the long run.

REFERENCES

- Aslanidis, N., and Xepapadeas, A. (2006) "Smooth Transition Pollution–Income Paths", *Ecological Economics*, 57(2): 182-189.
- Aydin, C., and Esen, Ö. (2017) "The Validity of the Environmental Kuznets Curve Hypothesis for CO2 Emissions in Turkey: New Evidence from Smooth Transition Regression Approach", *Mustafa Kemal University Journal of Social Sciences Institute*, 14(39): 101-116.
- Bhattarai, M., and Hammig, M. (2001) "Institutions and the Environmental Kuznets Curve for Deforestation: A Crosscountry Analysis for Latin America, Africa and Asia", *World development*, 29(6): 995-1010. [https://doi.org/10.1016/S0305-750X\(01\)00019-5](https://doi.org/10.1016/S0305-750X(01)00019-5).
- Bhattarai, M., and Hammig, M. (2004) "Governance, Economic Policy, and the Environmental Kuznets Curve for Natural Tropical Forests", *Environment and Development Economics*, 9(3): 367-382.
- Chiu, Y. B. (2017) "Carbon Dioxide, Income and Energy: Evidence from a Non-Linear Model", *Energy Economics*, 61, 279-288. <https://doi.org/10.1016/j.eneco.2016.11.022>
- Chiu, Y. B. (2012) "Deforestation and the Environmental Kuznets Curve in Developing Countries: A Panel Smooth Transition Regression Approach", *Canadian Journal of Agricultural Economics*, 60(2): 177-194. <https://doi.org/10.1111/j.1744-7976.2012.01251.x>
- Culas, R. J. (2007) "Deforestation and the Environmental Kuznets Curve: An Institutional Perspective", *Ecological Economics*, 61(2-3): 429-437. <https://doi.org/10.1016/j.ecolecon.2006.03.014>
- Ehrhardt-Martinez, K., Crenshaw, E. M., and Jenkins, J. C. (2002) "Deforestation and the Environmental Kuznets Curve: A Cross-National Investigation of Intervening Mechanisms". *Social Science Quarterly*, 83(1): 226-243. <https://doi.org/10.1111/1540-6237.00080>.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Esteve, V., and Tamarit, C. (2012) "Threshold Cointegration and Nonlinear Adjustment between CO2 and Income: The Environmental Kuznets Curve In Spain 1857–2007", *Energy Economics*, 34(6): 2148-2156. <https://doi.org/10.1016/j.eneco.2012.03.001>
- FAO (2016) "Global Forest Resources Assessment 2015", (accessed on 08/10/2018), <http://www.fao.org/3/a-i4793e.pdf>.
- FAO (2018) "Forestry Declarations", (accessed on 08/10/2018), <http://www.fao.org/forestry/32765/en/>
- Fernández-Amador, O., Francois, J. F., Oberdabernig, D. A., and Tomberger, P. (2017) "Carbon Dioxide Emissions and Economic Growth: An Assessment Based On Production And Consumption Emission Inventories", *Ecological Economics*, 135: 269-279.
- Fosten, J., Morley, B., and Taylor, T. (2012) "Dynamic Misspecification in the Environmental Kuznets Curve: Evidence from CO2 and SO2 Emissions in the United Kingdom", *Ecological Economics*, 76: 25-33. <https://doi.org/10.1016/j.ecolecon.2012.01.023>
- Fouquau, J., Hurlin, C., and Rabaud, I. (2008) "The Feldstein–Horioka Puzzle: A Panel Smooth Transition Regression Approach", *Economic Modelling*, 25: 284–299.
- Furuoka, F. (2015) "The CO2 Emissions–Development Nexus Revisited", *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 51, 1256-1275. <https://doi.org/10.1016/j.rser.2015.07.049>.
- Gonzalez, A., Terasvirta, T., and van Dijk, D. (2005) "Panel Smooth Transition Regression Model and an Application to Investment Under Credit Constraint", Working Paper in Economics and Finance, Stockholm School of Economics, Vol. 64.
- Grossman, G. M., and Krueger, A. B. (1991) "Environmental Impacts of a North American Free Trade Agreement". NBER Working Papers, WP. No: 3914.
- Grossman, G. M., and Krueger, A. B. (1995) "Economic Growth and the Environment", *The Quarterly Journal of Economics*, 110(2): 353-377.
- Heidari, H., Katircioğlu, S. T., and Saeidpour, L. (2015) "Economic Growth, CO2 Emissions, and Energy Consumption in the Five ASEAN Countries", *International Journal of Electrical Power & Energy Systems*, 64: 785-791. <https://doi.org/10.1016/j.ijepes.2014.07.081>
- Koop, G., and Tole, L. (1999) "Is There an environmental Kuznets Curve for Deforestation?", *Journal of Development economics*, 58(1): 231-244. [https://doi.org/10.1016/S0304-3878\(98\)00110-2](https://doi.org/10.1016/S0304-3878(98)00110-2).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Kuznets, S. (1955) "Economic Growth and Income Inequality", *The American Economic Review*, 45(1): 1-28.
- Lee, C.C., Chiu, Y.B., and Sun, C.H. (2009) "Deforestation, Environmental Kuznets Curve, and Threshold Effects: International Evidence", *Singapore Economic Review Conference*, August 6-8, Singapore. (accessed on 05/02/2018), https://editorialexpress.com/cgi-bin/conference/download.cgi?db_name=serc2009&paper_id=120.
- López, R., and Galinato, G. I. (2005) "Trade Policies, Economic Growth, and the Direct Causes of Deforestation", *Land Economics*, 81(2): 145-169. <http://dx.doi.org/10.3368/le.81.2.145>.
- Panayotou, T. (1993) "Empirical Tests and Policy Analysis of Environmental Degradation at Different Stages of Economic Development", WP. No: 238, Technology and Employment Programme, International Labour Organization, Geneva.
- Panayotou, T. (1993) "Empirical Tests and Policy Analysis of Environmental Degradation at Different Stages of Economic Development", ILO Working Papers. World Employment Programme Research. WEP 2-22/WP. 238 Geneva: International Labour Organization.
- Shafik, N., and Bandyopadhyay, S. (1992) "Economic Growth and Environmental Quality: Time-Series and Cross-Country Evidence", Policy Research Working Paper Series, WP. No: 904. Washington, DC: World Bank Publications.
- Selden, T. M., and Song, D. (1994) "Environmental Quality and Development: is there a Kuznets Curve for Air Pollution Emissions?", *Journal of Environmental Economics and management*, 27(2): 147-162. <https://doi.org/10.1006/jeem.1994.1031>
- Ogundari, K., Ademuwagun, A. A., and Ajao, O. A. (2017) "Revisiting Environmental Kuznets Curve in Sub-Sahara Africa: Evidence from Deforestation and all GHG Emissions from Agriculture", *International Journal of Social Economics*, 44(2): 222-231. <https://doi.org/10.1108/IJSE-02-2015-0034>.
- Zortuk, M., and Çeken, S. (2016) "Testing Environmental Kuznets Curve in the Selected Transition Economies with Panel Smooth Transition Regression Analysis", *Amfiteatru Economic Journal*, 18(43): 537-547.
- Wang, K. M. (2012) "Modelling The Nonlinear Relationship Between CO2 Emissions from Oil and Economic Growth", *Economic Modelling*, 29(5): 1537-1547.

**ENERJİ VADELİ İŞLEM FİYATLARI İLE DÖVİZ KURLARI ARASINDAKİ İLİŞKİ: ARDL
YAKLAŞIMI¹**

Çağatay BAŞARIR*

ÖZET

Türev ürünler, özellikle gelecekte ortaya çıkabilecek riskleri yönetebilmek için yatırımcılar tarafından, gerek korunma amaçlı gerekse yatırım amaçlı olarak kullanılan ürünlerdir. Günümüzde, çok farklı ürünlere ilişkin vadeli sözleşmeler geliştirilmiştir. Enerji emtialarına bağlı vadeli sözleşmeler spot piyasada olduğu gibi çok dikkat çekmektedir. Çalışmada enerji vadeli işlem fiyatları ile USD endeksi arasındaki ilişki ARDL ile irdelenmiştir. Çalışmada, 2006: 01 ile 2018: 09 dönemine ilişkin veriler kullanılmıştır. Çalışmada, tüm değişkenler sırasıyla bağımlı değişken haline getirilerek dört farklı model oluşturulmuştur. USD endeksinin ve Ham petrol değişkenlerinin bağımlı değişken olarak yer aldığı modellerde herhangi bir kointegrasyon ilişkisi bulunamamıştır. Ancak Kalorifer yakıtı ve Gaz değişkenlerinin bağımlı değişken olarak yer aldığı modellerde güçlü düzeyde uzun dönemde nedensellik ilişkisi tespit edilmiştir. Granger anlamda nedensellik analizlerine bakıldığında ise, %5 anlamlılık düzeyinde USD indeksinden, Ham petrol fiyatları ve Gaz fiyatlarına doğru tek yönlü bir nedensellik bulunmuşken, USD endeksi ile Kalorifer yakıtı arasında çift yönlü nedensellik tespit edilmiştir. Diğer değişkenler arasında herhangi bir nedensellik ilişkisi bulunamamıştır.

Anahtar Kelimeler: Enerji Vadeli Fiyatları, Döviz Kuru, ARDL, Nedensellik.

Jel Kodları: G13, F31, C58.

**RELATIONSHIP BETWEEN ENERGY FUTURE PRICES AND EXCHANGE RATES: ARDL
APPROACH**

ABSTRACT

Derivative instruments are used by the investors in order to hedge against risks as well as for investment returns especially to manage the future risks. Today, future contracts of different products are developed. Future instruments of energy commodities draw attention as they do in spot markets. In

¹ Bu çalışma Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi BAP (Bilimsel Araştırma Projeleri Koordinasyon) Birimi tarafından desteklenmiştir. Proje No: BAP-18-ÖSUBF-1009-117

* Dr. Öğretim Üyesi, Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi, Ö.S. Uygulamalı Bilimler Fakültesi, cbasarir@bandirma.edu.tr

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES**

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

the study, the relationship between energy future prices and USD index are analyzed using ARDL model. Data from 2006:01 and 2018:09 are investigated. In the study, four models are tested using the variables as dependent variable respectively. No integration relationship is detected when USD index and raw oil data are used as dependent variable. However, strong and long term causality relationship is found in the models when heating oil and gas are taken as dependent variable. When we look at the Granger Causality, unidirectional relationship from USD index to raw oil prices and gaz prices are found, and bidirectional relationship between USD index and heating oil are found at 5 % significance level. There is no causality relationship between the other variables.

Key Words: Energy Future Prices, Exchange Rates, ARDL, Casuality.

Jel Codes: G13, F31, C58.

1.GİRİŞ

Türev ürünler, emtia fiyatlarına, dövizde, faize ve borsa endekslerine bağlı olan finansal bir ürün olarak ifade edilmektedir. Türev ürünler organize borsalarda işlem görebilecekleri gibi tezgah üstü piyasalarda da alınıp satılabilmektedir. Bu piyasalarda faiz oranları, döviz kurları, borsa endeksleri, hisse senedi ve emtia fiyatlarına bağlı olarak birçok ürün yer almaktadır.

Emtia türevleri, özellikle petrol, petrol ürünleri, enerjiye dayalı ürünler ve kıymetli madenler gibi fiyat hareketliliği çok fazla olan ve piyasalarda en fazla alım satım konusu olan ürünlere dayanmaktadır. Özellikle hammaddelerin fiyatları bu ürünlere dayalı olan işletmeler bu ürünlerin fiyatlarını yakından takip etmekte ve ani fiyat hareketliliğine karşı önlem almak istemektedirler.

Risk yöneticileri, özellikle ani fiyat hareketlerine karşı bu türev ürünleri kullanmakta ve riski yönetmeye çalışmaktadırlar. Bu aşamada önemli olan riski başarılı bir şekilde yönetilmesidir. Böylece gerek enerji fiyatlarından gerekse dövizde meydana gelen hareketliliğe karşı önden tedbir olarak hammadde fiyatlarının hızlı bir şekilde artmasına karşılık olarak tedbir almaları gerekmektedir. Bu aşamada döviz fiyatlarındaki hareketlilik ile enerji fiyatlarındaki hareketlilik arasındaki ilişkinin belirlenmesi önem kazanmaktadır.

Çalışmada özellikle üretim maliyetleri açısından temel sayılabilecek enerji emtia vadeli işlem fiyatları ile döviz kurları arasındaki ilişki irdelenmiştir. Çalışmanın bundan sonraki kısmında öncelikle literatür özetine yer verilecek daha sonra ise ekonometrik uygulama açıklanacaktır.

2. LİTERATÜR TARAMASI

Son dönemlerde yapılan analizlerde, enerji emtia fiyatlarının, ABD dolarının yükseldiği sırada düşmekte olduğunu göstermektedir. Bunun önemli nedenlerinden birisi olarak, yükselen ABD dolarının, kısmen küresel ekonomik krizlerin bir kısmına bağlı olarak ABD para birimine olan talebin artmasına tepki göstermesinden kaynaklandığı düşünülmektedir. Enerji fiyatları ile döviz kurları arasındaki ilişki özellikle petrol fiyatları üzerinden çok fazla yapılmıştır. Ancak gerek future fiyatlar açısından gerekse diğer enerji fiyatları açısından yapılan çalışmalar ise çok kısıtlı düzeyde kalmıştır.

Bloomberg ve Harris (1995); emtia fiyatları ile döviz kurları arasındaki ilişkiye yönelik olarak yaptıkları çalışmalarında, özellikle emtia fiyatlarının zayıf dolar karşısında bir alternatif olarak artabileceğini öne sürmüşlerdir. Emtiaların homojen olmaları ve uluslararası piyasalarda işlem görüyor olmaları onların tek fiyat yasasına tabi olmalarına imkan tanımaktadır. Bu da emtiaların her ülke para birimi açısından benzer fiyatlara sahip olduğu anlamına gelmektedir. Böylece ABD doları diğer para birimlerine göre zayıfladığı zaman, ABD dışındaki emtia tüketicileri emtia girdileri için daha fazla dolar ödemek zorunda kalmaktadır. Sonuç olarak döviz kuru hareketlerinin emtia fiyat hareketlerindeki değişimler için önemli bir etken olabileceği düşünülmektedir.

Pindyck ve Rotemberg (1990), de çok farklı birbirleriyle ilişkisiz emtia fiyatları arasındaki co-movement ilişkisini analiz ettikleri çalışmalarında, bir çok emtianın birlikte hareket eğiliminde olduklarını tespit etmişlerdir. Özellikle, çeşitli döviz kurlarından oluşan ağırlıklı endeks ile petrol fiyatları arasında anlamlı ve negatif bir ilişki tespit etmişlerdir.

Serlitis (1994), yapmış olduğu çalışmasında, ham petrol, kalorifer yakıtı ve kurşunsuz benzin vadeli fiyatlarının kointegrasyon içerisinde olduklarını bulmuşlardır.

Sadorksy (2000) yapmış olduğu çalışmasında ham petrol, kalorifer yakıtı ve kurşunsuz benzin vadeli fiyatları ile ticari ağırlıklı döviz kuru endeksi arasında kointegrasyon ilişkisi tespit etmiştir.

3.YÖNTEM

Çalışmada değişkenler arasındaki kısa ve uzun dönemli nedensellik ilişkisi değişkenlerin zaman serisi karakterlerine göre belirlenmiştir. Öncelikle bir zaman serisi analizi yapılmadan önce zaman serisinin karakteristik özelliklerinin belirlenmesi ve ona göre yöntemin belirlenmesi gerekmektedir. Tablo 1’de çalışmada ele alınan veri seti, verilere ilişkin kısaltmalar, ele alınan dönem ve verilerin elde edildiği veri kaynakları yer almaktadır.

Tablo 1. Veri Seti

| Değişken | Kısaltma | Veri Aralığı | Veri Kaynağı |
|-----------------------------|-----------------|----------------------|---|
| USD | USD | Ocak 2006-Eylül 2018 | Federal Reserve Economic Data (https://fred.stlouisfed.org) |
| Ham petrol | CRUDE | Ocak 2006-Eylül 2018 | https://www.eia.gov/dnav/pet/pe t_pri_fut_s1_d.htm |
| Kalorifer Yakıtı | OIL | Ocak 2006-Eylül 2018 | https://www.eia.gov/dnav/pet/pe t_pri_fut_s1_d.htm |
| Gaz | GAS | Ocak 2006-Eylül 2018 | https://www.eia.gov/dnav/pet/pe t_pri_fut_s1_d.htm |

Çalışmada öncelikle serilerin birim kök analizleri yapılarak durağanlık durumlarının tespit edilmesi gerekmektedir. Rassal bir süreç izleyen zaman serilerinde, serinin durağan olup olmadığı çok önem kazanmaktadır. Stokastik bir değişkenin zaman içerisinde ortalaması, varyansı ve kovaryansının sabit olması durumunda serinin durağan olduğu söylenebilmektedir (Bozkurt, 2007: 27-28).

Durağanlık, serinin değerlerinin belli bir değere yaklaşmasını ya da beklenen değeri etrafında dalgalandığını göstermektedir (Sevüktekin ve Nargeleşkenler, 2007: 229). Eğer stokastik bir süreç izleyen zaman serileri değişkenlik gösteriyorsa, seri ele alınarak yapılabilecek bir tahmin sadece ele alınan dönem için geçerli olacaktır. Fakat bu seriden yola çıkılarak diğer dönemlere bir genelleme yapılamayacaktır. Zaman serilerinde, verilecek şokların etkisinin geçici olması ve bir süre sonra bu etkinin yok olması geleceğe yönelik olarak tahminlemeler açısından son derece önemlidir. Çalışmalarda durağan olmayan seriler ile çalışılması durumunda sahte regresyon problemi ile karşılaşılabilir. Bu şekilde yapılan analiz sonuçları gerçek sonuçları yansıtmayacak ve yanıltıcı sonuçlar ortaya çıkabilecektir (Bozkurt, 2007: 27). Burada amaç, geleceğe yönelik tahminlerde bulunmak ve tahmin dönemi dışında da değişkenlerin eğilimini tespit etmeye çalışmaktır.

Tablo 2. Birim Kök Testleri

| Değişken | ADF | | PP | | İntegrasyon Düzeyi |
|-------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|--------------------|
| | Trendsiz Sabit Terim | Trend ve Sabit Terim | Trendsiz Sabit Terim | Trend ve Sabit Terim | |
| CRUDE | -2.7800 (0.0636) | -3.0285 (0.1280) | -2.4501 (0.1300) | -2.6435 (0.2619) | I(1) |
| GAS | -3.2703 (0.0180) | -3.4144 (0.0533) | -2.4084 (0.1411) | -2.4998 (0.3279) | I(1) |
| OIL | -2.7365 (0.0703) | -2.8040 (0.1982) | -2.2512 (0.1894) | -2.3139 (0.4235) | I(1) |
| USD | -0.8215 (0.8098) | -2.2195 (0.4750) | -0.5927 (0.8676) | -1.9489 (0.6239) | I(1) |
| Birinci Farkları | | | | | |
| dCRUDE | -7.7985 (0.0000) | -7.7787 (0.0000) | -7.7364 (0.0000) | -7.7163 (0.0000) | |
| dGAS | -8.0349 (0.0000) | -8.0233 (0.0000) | -7.7705 (0.0000) | 7.7602 (0.0000) | |
| dOIL | -5.8713 (0.0000) | -5.8530 (0.0000) | -8.8838 (0.0000) | -8.8655 (0.0000) | |
| dUSD | -7.7596 (0.0000) | -7.9010 (0.0000) | -7.7596 (0.0000) | -7.9887 (0.0000) | |

Çalışmada birim kök testi olarak en tanınmış birim kök testleri olan, Geliştirilmiş Dickey-Fuller (ADF) ve Phillips-Perron (PP) testleri kullanılmıştır. Tablo 2 incelendiğinde, Birim kök testi sonuçları incelendiğinde serilerin hiç birinin ikinci düzeyden integre olmadıkları serilerin tamamının I (1) olduğu görülmektedir. Dolayısıyla ARDL (An Autoregressive Distributed Lag) modelinin uygulanması için herhangi bir sakıncalı durum görülmemektedir. Zaman serisi analizlerinde çoğunlukla (Johansen eşbütünleşme testi gibi) değişkenlerin aynı dereceden birim köke sahip olması istenmektedir. Ancak bu genellikle çok büyük bir kısıt olarak ortaya çıkmaktadır. Çünkü denklemlerde kullanılan değişkenlerin hepsinin aynı dereceden durağan olması çoğunlukla mümkün olmamaktadır. Fakat Pesaran ve Diğerleri (1996), tarafından geliştirilen ARDL yaklaşımına dayalı olarak değişkenlerin aynı anda hem kısa hem de uzun dönem ilişkisini ölçen yaklaşımda, farklı dereceden bütünleşik olan değişkenlerde de ilişki

durumu analiz edilebilmektedir (Esen ve Diğ, 2012: 256). ARDL modelinin, diğer yöntemlere göre özellikle küçük örneklerde daha başarılı sonuçlar verdiği, değişkenlerin dışsallık problemini dikkate aldığı ve model ile kısa ve uzun dönem parametrelerin tahmin edilmesine imkan verdiği için daha kullanışlı bir model olduğu söylenmektedir (Çil Yavuz, 2015:418). Bu modelin en büyük kısıtı ise model içerisinde yer alan değişkenlerin hiçbirinin ikinci düzeyden durağan olmaması gerekmesi durumudur. Çalışmanın bundan sonraki kısmında ARDL modeli tahmin edilecektir.

Çalışmada Akaike bilgi kriterine göre maksimum gecikme sayısı alınarak tüm değişkenler sırasıyla bağımlı değişken haline getirilerek **dört farklı** model oluşturulmuştur. Modellere ilişkin uzun dönem (Long run form), ECM (Error Correction Model-Hata Düzeltme Modeli), ve Kısa Dönem Pairwise Granger Nedensellik Analizi Sonuçları Tablo 3'de yer almaktadır.

Tablo 3. Analiz Sonuçları

| Bağımlı Değişken | T İstatistiği Uzun Dönem | Hata Düzeltme Modeli T istatistiği Kısa Dönem | Pairwise Granger Nedensellik Testi |
|------------------|--------------------------|---|---|
| USD | Kointegrasyon Yok | Kointegrasyon Yok | USD → Ham Petrol USD → Gaz USD ← Kalorifer Yakıtı |
| Ham Petrol | Kointegrasyon Yok | Kointegrasyon Yok | Bulunamamıştır |
| Kalorifer Yakıtı | Kointegrasyon | Kointegrasyon | Bulunamamıştır |
| Gaz | Kointegrasyon | Kointegrasyon | GAZ → Kalorifer Yakıtı |

Tablo 3 incelendiğinde oluşturulan modelden elde edilen sonuçlara göre USD endeksi ile ham petrol fiyatlarının bağımlı değişken olarak yer aldığı modellerde, değişkenler arasında herhangi bir uzun dönemli ilişkiye rastlanılmamışken, granger anlamda ise USD endeksinden ham petrol fiyatlarına ve gaz değişkenine doğru tek yönlü nedensellik, kalorifer yakıtı ile ise çift yönlü bir nedensellik tespit edilmiştir. Ham petrol fiyatlarının bağımlı değişken olduğu modelin granger analizi sonuçlarında se herhanhi bir nedensellik ilişkisi tespit edilememiştir. Kalorifer yakıtının bağımlı değişken olduğu modelde, ne kısa ne de uzun dönemde herhangi bir ilişki tespit edilememiştir. Gaz değişkeninin bağımlı değişken olarak yer aldığı modelde ise, değişkenler arasında uzun dönemli ilişki bulunamazken, granger anlamda gaz değişkeninden kalorifer yakıtına doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi tespit edilmiştir.

Model oluşturulduktan sonra, oluşturulan modellere ilişkin olarak tutarlılık testlerinin yapılması gerekmektedir. Oluşturulan dört modele ait olarak yapılan otokorelasyon, fonksiyonel form ve değişen varyans testlerine ilişkin sonuçlar tablo 4 de yer almaktadır.

Tablo 4. Modellere İlişkin Ön test Sonuçları

| | Model 1 (Bağımlı Değişken Ham petrol) | Model 2 (Bağımlı Değişken Kalorifer Yakıtı) | Model 3 (Bağımlı Değişken Gaz) | Model 4 (Bağımlı Değişken USD Endeksi) |
|--|--|--|---|---|
| Otokorelasyon (Ki kare Olasılık Değeri) | 0.006676 | 0.5847 | 0.7142 | 0.9812 |
| Fonksiyonel Form (Reset Testi) F İstatistiği | 0.118049 | 0.5311 | 0.4736 | 0.5274 |
| Değişen Varyans (Obs*R-kare Olasılık Değeri) | 0.1291 | 0.2967 | 0.8182 | 0.5956 |

Modellere ilişkin CUSUM ve CUSUM kare grafikleri incelendiğinde, modellerin kararlı bir model olduğu modellerin artıklarının sınır içinde kaldığı, modellerin parametrelerinin anlamlı olduğu ve herhangi bir yapısal değişim olmadığı görülmektedir.

Şekil 1. CUSUM ve CUSUM Kare İstatistikleri



4.SONUÇ VE ÖNERİLER

Türev ürünler, özellikle gelecekte ortaya çıkabilecek riskleri yönetebilmek için yatırımcılar tarafından, gerek korunma amaçlı gerekse yatırım amaçlı olarak kullanılan ürünlerdir. Günümüzde, çok farklı ürünlere ilişkin vadeli sözleşmeler geliştirilmiştir. Enerji emtialarına bağlı vadeli sözleşmeler spot piyasada olduğu gibi çok dikkat çekmektedir.

Çalışmanın sonucunda USD endeksinin ve Ham petrol değişkenlerinin bağımlı değişken olarak yer aldığı modellerde herhangi bir kointegrasyon ilişkisi bulunamamıştır. Ancak Kalorifer Yakıtı ve Gaz değişkenlerinin bağımlı değişken olarak yer aldığı modellerde güçlü düzeyde uzun dönemde nedensellik ilişkisi tespit edilmiştir.

Granger anlamda nedensellik analizlerine bakıldığında ise, %5 anlamlılık düzeyinde USD indeksinden, Ham petrol fiyatları ve Gaz fiyatlarına doğru tek yönlü bir nedensellik bulunmuşken, USD

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

endeksi ile Kalorifer yakıtı arasında çift yönlü nedensellik tespit edilmiştir. Diğer değişkenler arasında herhangi bir nedensellik ilişkisi bulunamamıştır.

KAYNAKÇA

Bloomberg, S.B., Harris, E.S., (1995) “The Commodity Consumer Price Connection: Fact or Fable?” Fed. Reserve Board N.Y. Econ. Policy Rev., October, 21 38.

Bozkurt, H. (2007) “Zaman Serileri Analizleri”, Bursa, Ekin Yayınları.

Çil Yavuz, N. (2015) “Finansal Ekonometri”, Baskı, Der Yayınları, İstanbul.

EIA, (2018). https://www.eia.gov/dnav/pet/pet_pri_fut_s1_d.htm, (12.10.2018)

Ethem, E., Yıldırım, S., ve Kostakoğlu, S. F. (2012) “Feldstein-Horioka Hipotezinin Türkiye Ekonomisi İçin Sınanması: ARDL Modeli Uygulaması”, Eskişehir Osmangazi Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, 7(1).

Federal Reserve Economic Data, (2018), <https://fred.stlouisfed.org>, (12.10.2018)

Kutlar, A. (2005) “Uygulamalı ekonometri” Nobel Kitabevi.

Pindyck, Robert S and Julio J Rotemberg (1990) “The Excess Co-Movement of Commodity Prices,” Economic Journal 100: 1173-89.

Sadorsky, P. (2000) “The Empirical Relationship Between Energy Futures Prices and Exchange Rates”. Energy Economics, 22(2): 253-266.

Serletis, A. (1994) “A Cointegration Analysis of Petroleum Futures Prices”, Energy Economics, 16(2): 93-97.

Sevüktekin, M., ve Nargeleçekenler, M. (2007) “Ekonometrik Zaman Serileri Analizi: E-Views Uygulamalı”. Nobel Yayın Dağıtım.

WATER SHORTAGE PROBLEM IN CENTRAL ASIA

Dr. Öğr. Üyesi Demet Şefika MANGIR*

Guncha Kerimkulyeva**

ABSTRACT

What is water? To understand water shortage we have to get inside the identification of the problem deeply. Water is an element which our planet and our lives are depending on. That's why the only idea of the water shortage sends them in tensions which create big conflicts among the people and nations. This research contains the background information of Central Asia and its water resources. This paper intends to provide an overview of the agreements over the transboundary issue of the rivers in the region. Especially it focuses on the main source of water for the countries of Central Asian regions, the Syr Darya and Amudarya Rivers. The aim of this paper was to research all the possible ways of confronting any conflicts, to seek the solution of the water problem between the countries of the region. Even if the water management of the Central Asian states is poor, it has to renovate future policies and hopes for the better framework on the water resources of the region. This paper also underlines the historical timeline of the water shortage problem of Central Asia, especially the period under the Soviet domination.

Keywords: *Water, Central Asia, Syr Darya, Amudarya, Soviet.*

ORTA ASYA'DA SU SORUNU

ÖZET

Su nedir? Su sorununu anlamak için bu problem üzerine bir derin tanımlanma yapılması gerekiyor. Su, gezegenimizin ve hayatlarımızın bağlı olduğu bir elementtir. Bu yüzden su kıtlığı'nın tek fikri bile insanları ve milletleri büyük çatışmalar yaratan gerilimlere yolluyor. Bu araştırma, Orta Asya'nın ve su kaynaklarının arka plan bilgilerini içermektedir. Bu çalışma, bölgedeki nehirlerin sınır ötesi meselesiyle ilgili anlaşmalara genel bir bakış sunmayı amaçlamaktadır. Özellikle bu çalışma Orta Asya bölgesindeki ülkelerin ana su kaynağı olan Syr Darya ve Amudarya Nehirlerine odaklanmaktadır. Bu çalışmanın amacı, herhangi bir çatışmanın önündeki olası tüm yolları araştırmak, bölge ülkeleri arasındaki su sorununun çözümünü aramaktır. Orta Asya devletlerinin su yönetimi zayıf olsa bile,

* Selcuk University, Turkey, acar.demet@gmail.com

** Selcuk University, Tajikistan, akramovichmohammed@gmail.com

***ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES***

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

gelecekteki yenilenecek politikalar sayvesinde bölgede su kaynakları üzerinde daha iyi bir çerçeve kurulması bir umud olarak görülür. Bu çalışma aynı zamanda, özellikle Sovyet hakimiyeti altındaki dönemde Orta Asya'nın su sorununun tarihsel zaman çizelgesinin altını çizmektedir.

Anahtar Kelime: *Su, Orta Asya, Syr Darya, Amudarya, Sovyet.*

1.INTRODUCTION

Water is the most valuable and irreplaceable resource on this planet. Without it, there would be no life. There would also be no global economy. As well as being essential for basic human needs, water plays a critical role in the world's key economic sectors, from agriculture and food processing, to oil and gas production, to semi-conductor manufacturing. Water literally fuels the economy. (Bigas, 2012, p. 12)

Central Asian states are located in the arid zone, in which it is impossible to cultivate crops and produce sustainable crops without irrigation. Therefore, in almost all countries of the region, irrigation exists and prevails, which requires a large amount of water resources. Central Asia has about 170-180 km of water resources, of which more than 90% are currently used. Water resources between the states of the region are unevenly divided. Over 90% of Central Asian water resources are concentrated in Kyrgyzstan and Tajikistan. At the same time, the main water consumers in the region are Uzbekistan and Kazakhstan, with Uzbekistan accounting for more than half of the water resources consumed.

The main source of water in the region is the Syr Darya and Amudarya streams, which form in the Pamir and Tien Shan mountains. Syrdarya flows from Kyrgyzstan through Tajikistan to Uzbekistan through the densely populated Fergana Valley and Kazakhstan, Amudarya from Tajikistan to Turkmenistan and Uzbekistan.

Therefore, Kyrgyzstan and Tajikistan actually control the water resources that are required for other Central Asian states. Kyrgyzstan and Tajikistan, in which the headwaters are located, consider water as a strategic commodity because they are poor in other resources and use water to produce electricity for their own needs. The countries rich in energy resources - Turkmenistan, Uzbekistan, and Kazakhstan - are dependent on Tajikistan and Kyrgyzstan for water, which form a schedule for the descent of water downwards.

In the first part of the work called "The definition of the water shortage", it was given a whole terminology background of the water and the water problem. At the first chapter the aim is to understand water shortage and for that we have to get inside the identification of the problem of the water shortage. This chapter was researched before by several academics so this following article only adjusts and

displays the important researches. Second chapter is called “Water Shortage and the International Law”. In this section, the role of deduction is given to the international law and the agreements which were concluded over water shortage problem. It is important to discuss the cocentions and law procedures to cope with the water crisis scare. In the third chapter called “Background of the Central Asian States on Water Resources” I tried to focus on background information of Central Asia and its water resources. Finally the fourth chapter is called “The Historical Timeline of The Water Shortage in Central Asia”. In this section, it is mainly discussed the fundamentals of nowadays situation in Central Asia. For this reason it was necessary to conclude this reaseach with showing the water shortage problem of Central Asia in historical timeline.

2. WATER SHORTAGE AND THE INTERNATIONAL LAW

In this chapter the role of deduction is given to the international law and the agreements which were concluded over water shortage problem. It is important to discuss the cocentions and law procedures to cope with the water crisis scare.

On of the main documents in the world on water problem is the 1992 Dublin Conference. This document is a reflection of the international debate on water policy and management over the past decade. The history of this issue can be traced further, up to the action plan adopted in Mara del Plata in 1977, but the 1992 Dublin Conference, which adopted the Dublin Statement on Water and Sustainable Development, which served as a contribution, served as the starting point in preparation for the Earth Summit in Rio de Janeiro. The Second World Water Forum, The Hague, 2000. Thus, over the years that has passed since the Rio de Janeiro Conference. In parallel, a number of other important events were carried out, the most important of which was the preparation of the World Water Perspectives, launched at the World Water Forum in The Hague in March 2000, and the proclamation of the Ministerial Declaration on Water Security in the 21st Century held in The Hague at the ministerial conference. This declaration identifies seven problems facing the world community. (www.unesco.org)

Another point that is necessary to opened up is the he United Nations Economic Commission for Europe. It was founded in 1947. It is one of the five regional commissions of the United Nations. The UNECE brings together 56 countries located in the EU, non-EU western and Eastern Europe, southeastern Europe, the Caucasus, Central Asia, and North America. All Central Asian states, Kyrgyzstan, Turkmenistan, Uzbekistan, Kazakhstan and Tajikistan are members of the UNECE since 1994. Along with other tasks, rules, standards and convention norms are being established within the UNECE framework in order to facilitate international cooperation in the region and beyond. (Akhmouch, 2018, p. 3)

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

The UNECE is well known for the five environmental conventions negotiated under the auspices of the UNECE and for which the UNECE acts as the secretariat:

Convention on Long-range Transboundary Air Pollution (1979 LRTAP Convention),

Convention on Environmental Impact Assessment in a Transboundary Context (Espoo Convention 1991),

Convention on the Protection and Use of Transboundary Watercourses and International Lakes (Water Convention 1992),

Convention on the Transboundary Effects of Industrial Accidents (Industrial Accidents Convention, 1992),

Convention on Access to Information, Public Participation in Decision-making and Access to Justice in Environmental Matters (Aarhus Convention 1998).

The Aarhus Convention was adopted on June 25, 1998 in Aarhus, Denmark, at the fourth Ministerial Conference “Environment for Europe”. The Convention entered into force on October 30, 2001 and as of August 2011, there are 44 Parties, including the EU. In Central Asia, the Parties are Kazakhstan, Kyrgyzstan, Tajikistan and Turkmenistan. (Cooley and Gleick, 2011, p. 712)

Bellie Sivakumar also brings up the case of international law in his resources by discussing the Helsinki rules. The “Helsinki Rules on the Uses of the Waters of International Rivers” were issued by the International Law Association in its meeting in Helsinki in 1966. Although the title of the Helsinki Rules refers to international rivers only, Article I states that the Rules are applicable to the use of the waters of an international drainage basin. Such a drainage basin is defined as “a geographical area extending over two or more States determined by the watershed limits of the system of waters, including surface and underground waters, flowing into a common terminus.” As such, the Helsinki Rules also apply to groundwater connected to surface water. This was the first time that transboundary groundwater was addressed by any international legal instrument. The Helsinki Rules established the principle of “reasonable and equitable utilization” of the waters of an international drainage basin among the riparian states as the basic principle of international water law. For that purpose, the Helsinki Rules specified a number of factors for determining the reasonable and equitable share for each basin state. (Sivakumar, 2011: 541)

3. BACKGROUND OF THE CENTRAL ASIAN STATES ON WATER RESOURCES

This chapter is the breaking point on this research as it contains the background information of Central Asia and its water resources. Central Asia is home to sixty-one million citizens spread across

five countries: Uzbekistan, Tajikistan, Turkmenistan, Kyrgyz Republic, and Kazakhstan. As the chart below illustrates, there is a high level of poverty in the region. The notable exception, in terms of economic performance, is Kazakhstan, which has relatively low poverty levels and the highest Gross Domestic Product per capita due to their large fossil fuel reserves. (Castillo, Izquierdo, Jimenez, Stangerhaugen, Nixon, p. 6)

The two main sources of water in Central Asia are the Syr Darya and Amu Darya Rivers, which is the larger of the two. The Amu Darya originates in Tajikistan and flows along the border between Afghanistan and Uzbekistan, and goes through Turkmenistan before returning to Uzbekistan and discharging in the Aral Sea. (ВОЛЬМУРАДОВ, p. 9) When combined, the Amu Darya and Syr Darya rivers have about 77 cubic kilometers of water, 96 percent of which is used for irrigation. Other major inter-state rivers include Chu, Talas, Tarim, and Irtysh.

Most of the rivers of Central Asia have glacier-snow feed. They are characterized by small fluctuations in the annual runoff and the high water stretched over time which along with a steep fall in the bed, makes them especially valuable for economic use, i.e. hydropower generation and irrigation. (Chevallier, 2014, p. 1493)

In Central Asia, the Caspian Sea is the only water body legally defined as a “marine environment” in accordance with the 2003 Framework Convention for the Protection of the Marine Environment of the Caspian Sea. Some 130 rivers, including major transboundary rivers such as the Volga, Kura, Terek, Ural and Sulak, flow into the Caspian Sea. (Камьнин, Лазарева, Лапенко, Лямзин, 2017, p. 41) These rivers form the most important part of the entire Caspian ecosystem, and the wide river network and extensive wetlands are habitats of various flora and fauna.

Table 2. Total water resources (share of outside sources)

| Country | (km³/year) | M³/capita per year |
|---------------------|------------------------------|--------------------------------------|
| Kazakhstan | 117 (34) | 6 490 |
| Kyrgyzstan | 58 (0) | 8 480 |
| Tajikistan | 99 (16) | 13 500 |
| Turkmenistan | 25 (23) | 4 090 |
| Uzbekistan | 59 (34) | 1 870 |

This table above is given to analyze the water resources of each Central Asian states. As we see the highest supplementation of water belongs to Tajikistan and Kyrgyzstan.

4. THE HISTORICAL TIMELINE OF THE WATER SHORTAGE IN CENTRAL ASIA

This final chapter is mainly the fundamentals of nowadays situation in Central Asia. For this reason it was necessary to conclude this research with showing the water shortage problem of Central Asia in historical timeline. This timeline includes the pre-soviet era, the soviet era and the post soviet era. Records show more than 1,200 dams were built in the region during the Soviet era, among them is the Nurek Dam, the second largest dam in the world. (Burghart, 2004: 211)

The current state of water management in Central Asia is a consequence of poor governance in the past. Local water management practices were destroyed, and the centralized system did not pay attention to the social and environmental consequences of the mismanagement of resources in this region. After the colonization of Central Asia, in the process of creating new republics, the rivers played a very important strategic role in distinguishing economically sound units and increasing interdependence between the new states. With the collapse of the Soviet Union, the centralized system of water management also collapsed. The Syr Darya and Amu Darya have become international rivers, to the use of which the new republics have a different interest, and this situation requires coordination. (Ференц, р. 63)

The current water sharing within Central Asia dates from the 1992 Almaty Agreement in which the five states agreed to adhere to an “established pattern and principles of allocation”, basically codifying existing practices. The Almaty Agreement was signed in haste, only a few weeks after the Central Asian states became independent from the Soviet Union and little thought was given to its long-term consequences. By signing the Almaty Agreement the Central Asian states chose to keep Soviet allocations unchanged, meaning that the bulk of the region’s water resources is still allocated to the downstream countries, leaving the upstream countries with little access to the water generated on their territory.

One of the Soviet era policies were the first water management legal act – a “Decree on the Allocation of 50 Million Rubles for Irrigation Works in Turkestan and the Organization of such Works” signed by Lenin in May 1918. This document envisaged the priority of irrigation development in Fergana, Chui and Zerafshan valleys and also in the Golodnaya and Dalverzinskaya steppes. Soon the Department of Irrigation Works in Turkestan, headed by the famous Rozinkampf, was created. (Valentini, Orolbaev, Abylgazieva: 21)

Soon after the end of the Great Patriotic War, in 1946 “the Law on the Five-year Plan of Rehabilitation and Development of the USSR Economy” was passed and then a series of special resolutions encouraging an accelerated upgrading of the irrigation infrastructure were adopted. Among them is a rather interesting resolution of the Council of Ministers of the USSR of 1950: “On the transition to a new system of irrigation for the purpose of a more complete use of irrigated lands and improvement of mechanization of agricultural works”. But in that list the Karamum canal, naturally named after Lenin as were the majority of other construction projects, would stand out. As if the well-known Suez Canal, whose length is only 161 kilometers, not to mention the Panama Canal, only half as long and constructed over dozens of years, could compare. This canal, laid out in the desert for 800 kilometers, was constructed in just over 5 years. The world has not known such a pace of hydro construction. (Valentini, Orolbaev, Abylgazieva, p. 29)

5.CONCLUSION

On the conclusion of this research I have to admit the importance of the water problem in the world especially in the Central Asian region. The aim of this paper was to research all the possible ways of confronting any conflicts, to seek for the solution of the water problem between the countries of the region. Even if the water management of the Central Asian states are poor, it has a renovating future policies and hopes for the better framework on the water resources of the region. Followingly, I shared some examples of the successful regional cooperation on water resources over the world.

Regional cooperation is essential to creating transboundary relationships that result in optimal levels of water, food and health security for all users sharing a particular river system. International examples, such as that of the Nile River Basin, suggest that effectively orchestrated basin-scale management of water resources can generate increased benefits for all within a regional context if there is cooperation between all stakeholders.

Other globally relevant models also exist, such as Canada’s Northwest Territories ‘Northern Waters, Northern Voices’ water stewardship strategy, which demonstrates how the rights of both people and nature to water can be a foundation of sustainable economic development.

Another important example of successful international agreements over water management standards is the European Union Water Framework Directive. In this framework, water quality standards and parameters of aquatic ecosystem health are defined by the EU, but individual nations are charged with meeting those standards based on the strategy they decide will work best in local circumstances. Furthermore, the EU model links both agricultural and water policy, and it is a model which may be

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

useful to examine in other regional contexts, such as in North America. (Bigas , Morris, Sandford, Adeel, 2012: 18)

REFERENCES

- Akhmouch A., DelphineClavreul, Peter Glas. “Introducing the OECD Principles on Water Governance”, *Water International*, 43 (1): 3
- Bigas H., Tim M., Sandford B. and Adeel Z., (2012) “The Global Water Crisis: Addressing an Urgent Security Issue”, *Papers for the InterAction Council*, Harriet Bigas (Ed.), Hamilton, Canada: United Nations University – Institute for Water, Environment and Health.
- Burghart D., Sabonis-Helf T. (2004) “In The Tracks of Tamerlane: Central Asia’s Path to The 21st Century”, Washington, D.C.: National Defense University Center for Technology and National Security Policy: 212
- Castillo D., Izquierdo L. M., Jimenez G., Stangerhaugen M., Nixon R. (2012) “Water Crisis in Central Asia Key Challenges and Opportunities”, <https://milanoschool.org/wp-content/uploads/2012/10/Water-crisis-in-Central-Asia-Key-Challenges-and-Opportunities.doc>
- Chevallier P., Pouyaud B., Mojařsky M., Bolgov M., Olsson O., Bauer M. and Froebrich, J. (2014) “River Flow Regime and Snow Cover of the Pamir Alay (Central Asia) in a Changing Climate”, *Hydrological Sciences Journal*, 59 (8): 1493
- Cooley Heather, Peter H. Gleick, (2011) “Climate-Proofing Transboundary Water Agreements”, *Hydrological Sciences Journal*, 56 (4): 712
- Sivakumar Bellie (2011) “Water Crisis: From Conflict to Cooperation—an Overview”, *Hydrological Sciences Journal*, 56 (4): 541
- Valentini K.L., Orolbaev E.E, Abylgazieva A.K. “Water problems of Central Asia” [,http://library.fes.de/pdf-files/bueros/zentralasien/50116.pdf](http://library.fes.de/pdf-files/bueros/zentralasien/50116.pdf)
- Вольмурадов Курбангельды. “Водные Ресурсы Туркменистана: Потенциал, Использование, Технология И Экология”, <http://www.cawater-info.net/library/rus/almaty/volmuradov.pdf>
- Безопасность Водных Ресурсов: Предварительная Оценка Хода Разработки Политики После Конференции В Рио-Де-Жанейро” http://www.unesco.org/new/fileadmin/MULTIMEDIA/HQ/SC/pdf/wwap_water_security_rus.pdf

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Ференц Аго. “Центральноазиатская интеграция: проблема распределения водных ресурсов
Диссертация на соискание учёной степени кандидата географических наук, Республика
Венгрия Печ, http://old.foldrajz.ttk.pte.hu/phd/phdkoord/nv/disszert/diszertacio_ago_nv.pdf

Камынин В. Д., Е. В. Лазарева, М. В. Лапенко, А. В. Лямзин. Центральная Азия на рубеже XX–
XXI веков : политика, экономика, безопасность, В. И. Михайленко (Ed.), Рос. Федерации,
Екатеринбург : Изд-во Урал. ун-та, 2017, р. 44

ЧАРЫЕВ Максат, Туркменистан: Управление Охраной Окружающей Среды,
[http://wecoop2.eu/sites/default/files/documents/6th%20WGECC/10.%20Maksat%20Charyyev_
Turkmenistan_Presentation%20RUS.pdf](http://wecoop2.eu/sites/default/files/documents/6th%20WGECC/10.%20Maksat%20Charyyev_Turkmenistan_Presentation%20RUS.pdf)



UNITED STATES' FOREIGN POLICY TOWARDS CENTRAL ASIA

Demet Şefika MANGIR*

Mukhammadjon GANIEV**

ABSTRACT

Central Asia has been and remains a region in which the interests of world and some regional powers are intertwined. The collapse of the Soviet Union created a vacuum in Central Asia and it drew the attention of the main centers of power including Washington. The first steps of the U.S policy toward the Central Asian countries were to make a careful assessments of events marking the transformation of the Soviet Union and also an initial search for a points of contact with each country in the region. The United States was not only interested at preserving the statehood of Central Asian countries, but also to prevent the spread of religious extremism in the region. However, after the deployment of U.S troops and NATO units to Afghanistan in 2001, as a result of successful foreign policy actions in the Central Asian region, Washington was able to significantly improve its economic, political and strategic influence in Central Asia. Thus, this paper seeks to analyze the U.S foreign policy towards Central Asia, taking into account the geopolitical position of the Central Asian region.

Keywords: *United States, Soviet Union, Central Asia, World Power, Foreign Policy.*

1.INTRODUCTION

The significance of U.S foreign policy towards Central Asia should be emphasized, because for a period it used to determine what should happen in this region. The U.S struggle to have some influence in Central Asia reflects the growing importance of the states of the region on the world stage. The recent history of the end of the 20th century and the beginning of the 21st century has pushed Central Asia among the regions that have a tangible impact on security in the world. Central Asia is a middle geopolitical space, traditionally important on a global and regional scale. Historically, Central Asia maintained contacts with China, Persia, India and Russia. The region reached its heyday in the Middle Ages, which was noted by the scientific achievements of Bukhara and Samarkand, the rise of the Great Silk Road and the conquests of Timur. However, since the era of the Great Geographical Discoveries, it has gradually become isolated from the sea trade routes and new centers of emerging international life. In the 60-90s of the XIX century after the occupation of Turkestan, Maverannahr, Turkmen oases and a

* Selcuk University, Turkey, acar.demet@gmail.com

** Selcuk University, Tajikistan, akramovichmohammed@gmail.com

number of other territories by the Russian Empire, the Central Asian peoples became part of the Tsarist Russia and then USSR, where they remained for more than a century. In 1991, with the end of the existence of the USSR, a new stage of their independent development came and at the same time the place of Central Asia in the geopolitical picture of the world changed.

After the deployment of U.S troops and NATO units to Afghanistan in 2001, as a result of successful foreign policy actions in the Central Asian region, Washington was able to significantly improve its economic, political and strategic influence in Central Asia. The United States of America for the first time had the opportunity to implement a number of foreign policy initiatives in Central Asia to gain a foothold in parts of the Heartland space, including the modern Central Asian republics. The U.S widely used its military and political influence as one of the most important instruments for strategic consolidation in Central Asia. However, this was not the only means in the spectrum of the U.S foreign policy capabilities. Along with the military component, Washington also used political-diplomatic, economic and humanitarian opportunities for interaction with the countries of Central Asia. The decision to use this or that instrument in foreign policy is made by the American leadership on the basis of its own national interests. This paper discusses United States' Foreign Policy towards Central Asia, taking into account the geopolitical position of the Central Asian region.

2.U.S FOREIGN POLICY TOWARDS CA PRIOR TO SEPTEMBER 11, 2001

The United States of America showed interests in Central Asia immediately after the independence of Central Asian countries. According to the general American policy of globalism, Central Asia was a part of its considerable interests. By the end of XX century, these ideas have acquired new features, based on the changed geopolitical situation in the world and the disintegration of the USSR as well as the weakness of the new independent states that emerged instead of it. The Central Asian region as a geopolitical space stretches from China in the east to the Caspian Sea in the west and from Russia in the north to Afghanistan and Iran in the south. The region consists of Kazakhstan, Kyrgyzstan, Tajikistan, Turkmenistan and Uzbekistan that became independent after the collapse of USSR. Ethnically, except Persian-speaking Tajiks the other peoples of Central Asia are quite close to each other as they are Turkic origin. The overwhelming majority of the population are Muslims. The geopolitical position of the region is largely determined by its importance in the system of global communications and international security on the forms of cooperation between states like Russia, USA, PRC as well as the countries of this region. The Caspian region also has acquired a qualitatively new role in the hierarchy of world economic and political interests. (Ташматова, 2008, p. 15). A. D. Bogaturova, a Russian researcher on competent opinion says, "The growing attention of the most powerful powers to

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Central Asia in the first decade of the 21st century is a sign of the region's return to the focus of main international policies".(Боратыров, 2011, p. 13).

The United States is embarking on a course to prevent the appearance of a dominant antagonistic forces in Eurasia that will limit the ability of the U.S to exercise global leadership. We are talking about Russia and China as capable states that especially with joint efforts are not only trying to restrict U.S activities in Central Asia, but also in Eurasia. In this regard, on the one hand, the U.S is trying to prevent the restoration of Russia's strategic control in this territory and the creation of a political alliance between Moscow, Beijing and Tehran. On the other hand, the U.S needs cooperation with Russia in order to avoid destabilization in Eurasia which also threatens Central Asian countries. According to experts, any form of U.S-Russian confrontation threatens to split Central Asia.(Гумеров, 2009, p. 36). The U.S is interested not only in limiting the influence of individual states in Central Asia, but also in a number of so-called transnational threats like terrorism, drug trafficking and the proliferation of Weapon of Mass Destruction (WMD), uncontrolled migration and human trafficking.

James Collins, who was a Special Advisor to the Secretary of State for New Independent States formulated U.S interests in the region as following:

U.S support for the independence, sovereignty and security of Central Asian States

U.S assistance for the establishment of free-market economies and democratic governments of the region

The integration of Central Asian States into the world community of political and financial institutions and their participation in the Euro-Atlantic security dialogue and cooperative programs

Encouragement of Central Asian States to pursue peaceful relations among themselves, as well as such relations with their neighbors and to seek new avenues for regional cooperation and to resolve local conflicts as soon as possible

Prevention of WMD trafficking and their elements across Central Asia, especially Kazakhstan and across the borders of the region

Enhancement of american commercial interests with expansion and diversification of global energy supplies.(Iftekharul, 2011: 35-36).

This was the list of U.S interests in Central Asia which then repeatedly mentioned in official documents of the U.S administration. It should be noted that Washington reached its aims and could protect American interests prior to September 11, but one. That was the establishment of democratic governments in the region. From 1991 to 2001 in the ruling circles of the United States prevailed the

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

view that the economic interests of the United States in the region as a whole are insignificant. Nevertheless, the administration of Bill Clinton paid great attention to ensuring the access of American goods, services and capitals to the markets of Central Asian states. These contradictions in U.S policy were related to the narrowness of the Central Asian markets, the minimum weight of the region's countries in the world economy and the underdeveloped infrastructure.

Another significant issue of U.S diplomacy of this period was whether to intensify political and especially military-political relations with the Central Asian states to control the radical Islamist regimes of neighboring states, primarily Afghanistan or. In 1996, after the capture of Kabul by the Taliban, the State Department first announced recognition of their authority. But gradually this policy began to be corrected. This was not only due to the barbarous actions of the Taliban, but also to the reaction of the Central Asian leaders to U.S actions. Military cooperation with Central Asian countries continued to strengthen. By that time, Kazakhstan, Uzbekistan and Kyrgyzstan had already cooperated with NATO, where the United States occupies a leading position within the framework of the Partnership for Peace (PfP) program. The strengthening of military cooperation was not only due to the U.S desire to reduce Russia's influence on the countries of Central Asia, but also to prevent a significant expansion of the Chinese economic in the region. In the second half of the 1990s, Washington tried not to publicize the policy of opposing Iran's influence in the region as well as limiting its economic cooperation with the Central Asian states. Thus, in 1997, the United States could block the construction of an oil pipeline from Kazakhstan to Iran. (Троицкий, 2010, p. 81).

In 1999, the U.S Congress adopted the Law on the Great Silk Road Strategy, which legally formalized the U.S foreign policy strategy for Central Asia and the Caucasus, recognized as a single region. The law determined the procedure and conditions for the provision of economic assistance and the maintenance of political independence of these countries. During this period, the greatest emphasis in the Central Asian policy of the United States was made on Kazakhstan as a state with significant hydrocarbon reserves and the most favorable policy of attracting foreign investments into this sphere of the economy. Thus, Over 28 years U.S policy in the region has gone a long way. It has developed gradually, but systematically.

3.U.S FOREIGN POLICY TOWARDS CENTRAL ASIA AFTER SEPTEMBER 11, 2001

The next stage in American policy in Central Asia came after the events of September 11, 2001, when NATO troops were deployed to Afghanistan within the framework of the international anti-terrorist coalition. September 11 events also caused American penetration into Central Asia through the military line. The U.S military presence in Central Asia increased dramatically as opportunities were

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

given by the governments of the region. The peculiarity of American foreign policy activities after September 11 was the fusion of two concepts: Revolution in Strategic Affairs and Revolution in Military Affairs. This means that the U.S armed forces could be deployed anywhere for global power projection, as they had the political support of the U.S State Department. For Central Asia, this meant that the region has become the strategic base for the long-term unilateral domination of the United States. (Кузьмина, 2007. P. 78).

To increase the efficiency of aviation use and maximize the full utilization of the given freedom of action in the sky over Central Asia, the Pentagon has achieved the opening of its military air bases in Uzbekistan and Kyrgyzstan. According to the context of the October 2001 agreement, rights were obtained to NATO for basing at the Karshi-Khanabad Air Force base in Uzbekistan (according to the American reduction – “K-2 base”). The facility was intended to support the fighting in Afghanistan. (Steven, 2005). At the same time, the United States and NATO have increased the volume of military assistance to Uzbekistan. The base was used to supply troops, conduct combat operations and perform unmanned aerial vehicles which lasted until the Andijan crisis of 2005 and the subsequent sharp deterioration of U.S relations with Uzbekistan. Considering Washington's approach to the events in the Ferghana Valley as a violation of partner commitments, Tashkent demanded to withdraw the object from its territory. By November 2005, the U.S Armed Forces ceased all operations with the K-2, having transferred part of the personnels to Kyrgyz International Airport Manas. The normalization of the dialogue with the Uzbek leader Islam Karimov had already been succeeded by the new American administration of B. Obama. Despite the fact that Tashkent regained its status as the main military-political partner of the United States in the region, the distrust of the parties to each other (after the Andijan events) did not end, and the Foreign Policy Concept of the Republic of Uzbekistan adopted in 2012 prohibited the establishment of new foreign military facilities on the territory of the republic. (Попов, 2016, p. 46-50).

On December 11, 2001, the parliament of Kyrgyzstan approved an agreement on the Western coalition and especially U.S use of Manas International Airport in Bishkek. In accordance with the agreement of the parties, the U.S base could be used by both transport and combat aircraft. The base received extensive tax and administrative benefits, as well as the opportunity to use any telecommunications systems and all the necessary spectrum of radio frequencies. (Князев, 2004, p. 319-321).

In November-December 2004, the Americans initiated closed negotiations with the President of Kyrgyzstan Askar Akayev on the deployment of AWACS E-3A aircraft to Manas and their reconnaissance flights along the border with China, however, after consultations with the Collective

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Security Treaty Organization and Shanghai Cooperation Organisation members, Bishkek refused. Moreover, A. Akayev did not give guarantees of preserving the U.S base after the next parliamentary elections. Americans perceived it as a challenge and took the policy of shifting the government of the republic as Askar Akaev commented after his resignation.(Акаев А, 2009). Having seized power in coup d'état in March 2005, the new leadership of the country led by Kurmanbek Bakiyev expressed loyalty to the White House in maintaining the base. In the summer of 2009, the Kyrgyz authorities agreed with the Pentagon to maintain the air base under a new name of Transit Center. After the bloody events of spring-summer 2010 and the run of the Bakiyevs from the country, the new authorities of the republic initiated negotiations with the U.S about the future of the air base. Nevertheless, its results did not take long and the Transit Center in Bishkek airport was closed in June 2014.(РИА Новости, 2012).

In 2001 Kazakhstan sanctioned free and unlimited flights of U.S air forces in its airspace, which allowed including transportation of any types of cargo, including lethal ones. From 2001 to 2010 the number of such flights was about 9 thousand or more than 1 thousand per year.(Roger, 2012). In 2002 Kazakhstan was the first Central Asian country that allowed emergency landing of U.S aircraft at the International Airports of Almaty and Astana in case of bad weather or an emergency. Kazakhstan also granted U.S rights of overflight through Kazakhstani airspace, as well as transportation of goods to Uzbekistan and Kyrgyzstan through its territory.(Ташматова, 2008, p. 74). In 2005, Astana opened additional air corridors for U.S aviation, and in April 2010 President N. Nazarbayev at a meeting with B. Obama at the Nuclear Security Summit in Washington agreed to carry out through the territory of the republic the transpolar flights from the USA to Afghanistan.

A special position on this issue was taken by Turkmenistan, the only state in the region that had previously established official relations with the Taliban government and those relations were characterized as very good by the former Minister of Foreign Affairs of the Taliban Movement, V. A. Motawakil.(Фахим, 2012). Immediately after the September 11 attacks, the Turkmen Foreign Ministry said that it excludes the possibility of participation in the coalition led by the United States in Afghanistan, citing the status of permanent neutrality of Turkmenistan. Subsequently, Ashgabat nevertheless agreed to airlifts through its territory and allowed refueling of aircraft following humanitarian purposes, but publicly tried not to advertise this fact, and flights that were incompatible with the classical neutral status were presented as accomplishment of a humanitarian mission.(Попов, 2016, p. 44).

The North Atlantic alliance also began to actively use Tajikistan with its longest border with Islamic Republic of Afghanistan. Tajikistan also allowed the Pentagon (and later the French military) to use Dushanbe airport in emergency cases and for refueling aircraft. From December 2001 to October

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

2014, the Dushanbe International Airport was used by the French Air Force to support the French contingent in Afghanistan.

As for economic interactions of U.S with CA, for decades the unconditional economic priority of the United States in all parts of the world remains access to oil. In Central Asia, this resource is mostly concentrated in Kazakhstan and Turkmenistan. Western companies massively rushed to the newly opened republics of the Caucasus and Central Asia immediately after the collapse of the USSR, assessing the prospects of the Caspian Sea as one of the few undeveloped areas of world oil and gas production. In such circumstances, the U.S had a strong position and economic expansion of the American giants in the oil and gas regions of Central Asia. (Тренин, 2005, р. 3-5). Generally, since the beginning of the 2000s until now (2018) the U.S focuses on economic interaction with Central Asian countries and primarily with Kazakhstan, Turkmenistan and Uzbekistan. However, the main industries that attracted significant investments from U.S corporations were oil and gas production, the pipeline sector, mining, food, textile industries, air transport and telecommunications, industry and the agrarian sector (primarily cotton and wheat). Indeed, these branches of the economy of Central Asian countries will retain their attractiveness for corporations with the United States as well as with other countries.

4. CONCLUSION

U.S policy toward Central Asia was one of the main external factors influencing the formation of the situation in and around this region for a period. The evolution of the American approach to defining the role and place of Central Asian states in the U.S foreign policy strategy, as well as the methods and forms of interaction with them reflects the growing importance of the region on the world stage. In general, this approach is characterized by the perception of the region as a historically established socio-political, economic and military-political whole. For the United States, penetration into the region allows influencing the policy of the whole Eurasia, and U.S seeks to prevent the emergence of a dominant and antagonistic force in Eurasia. This role can only be played by Russia and China, which together can limit the capabilities of the United States in Eurasia and deprive Washington of its claim to world domination.

Having made a geostrategic breakthrough in the Central Asian region, the United States gradually began to more decisively declare its intention to consolidate here on a long-term basis, without defining the time limits for its presence (in August 2004, U.S President George W. Bush stated that the United States intends to ensure permanent access to strategic sites in the region). The focus of Americans on strategic energy facilities and resources, communication is a constant attribute of most American developments in Central Asia, and this is supported by a number of specific measures. In general, taking

advantage of the situation and its wide possibilities of projecting its own power into the region, Washington was pragmatically fixed here with the primary goal of establishing control over the energy and other resources of Central Asia, with which it is very rich.

The evolutionary course of the United States in Central Asia can be singled out in two stages: U.S foreign policy towards CA prior to September 11, 2001 and after September 11, 2001. Prior to September 11, Washington showed a relatively weak interest in the region and the prevailing view was that the United States did not have vital interests in it. In a concentrated form, the essence of U.S policy was to prevent the emergence of an intra-regional conflict in Central Asia, which was the key to solving domestic problems, achieving stability and establishing democracy based on successful economic development. After September 11, the mobilization and consolidation of the world community under the flag of combating international terrorism, the creation of an anti-terrorist coalition against al-Qaeda and its ally (the Taliban regime in Afghanistan), accelerated and facilitated the penetration of the United States into Central Asian countries.

BIBLIOGRAPHIES

- Iftekhharul Islam. (2011) "The U.S. Role and Policy in Central Asia: Energy and Beyond", University of Dhaka.
- Roger N. M. "Kazakhstan Hosts Steppe Eagle 2012". <https://jamestown.org/program/kazakhstan-hosts-steppe-eagle-2012/> [Accessed: 27. 07. 18.].
- Steven R. Weisman S. (2005) "Uzbeks Order U.S. from Base in Refugee Rift", <https://www.nytimes.com/2005/07/31/world/uzbeks-order-us-from-base-in-refugee-rift.html> [Accessed: 23. 08. 18.].
- Акаев, А. (2009) "США Предпринимали Попытку Вести Разведывательные Полеты над Китаем с Базы в Киргизии". <https://regnum.ru/news/1226556.html> [Accessed: 28. 05. 18.].
- Богатуров А. Д. (2011) "Международные Отношения в Центральной Азии: События И Документы", Москва: Аспект Пресс.
- Гумеров Родион Альфредович. (2009) "Геополитические Интересы США, Китая И России В Центральной Азии", Неопубликованная Кандидатская Диссертация, Москва: Дипломатическая Академия МИД Российской Федерации.
- Князев Александр Алексеевич. (2004) "Влияние Афганского Кризиса на Безопасность Центральной Азии", Неопубликованная Кандидатская Диссертация, Бишкек: Кыргызско-Российский Славянский Университет.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Кузьмина Екатерина Михайловна. (2007) “Геополитика Центральной Азии”, Москва: Наука.
- Попов, Д. С. (2016) “Центральная Азия во Внешней Политике США”. 1991–2016 гг. Москва: РИСИ.
- РИА Новости. (2012) “Атамбаев Заверил, что После 2014 Года Манас Будет Гражданским Объектом”. <https://ria.ru/world/20120920/754791579.html> [Accessed: 25. 08. 18.].
- Ташматова Салтанат Изатбековна. (2008) “Политика США в Отношении Стран Центральной Азии”, Неопубликованная Кандидатская Диссертация. Москва: Дипломатическая Академия МИД Российской Федерации.
- Тренин, Д. (2005) “Россия Между Китаем и Америкой. Трехчленная Конструкция Пекин - Москва - Вашингтон Вновь Приобретает Реальные Черты”, Pro et Contra. 32 (43): 2005
- Троицкий Евгений Флорентьевич. (2010) “Центральная Азия в Системе Международных Отношений (1992 – 2009 гг.)”, Томск: Издательство Томского Университета.
- Фахим, С. (2012) “Туркменистан и Афганистан: От Нейтралитета К Сотрудничеству”. <http://www.afghanistan.ru/doc/23210.html> [Accessed: 30. 08. 18.].



ICOAEF
Extended With
Social Sciences

**TÜRKİYE'DE İLLER DÜZEYİNDE SEKTÖREL KAMU YATIRIMLARI İLE İHRACAT
ARASINDAKİ EŞBÜTÜNLEŞİK İLİŞKİLER**

Doç. Dr. Burcu TÜRKCAN*

ÖZET

Ticaret ve kamu yatırımlarının bölgesel düzeyde ilişkisinin önemine binaen hazırlanan bu çalışmada 2003 – 2017 yılları arasında Türkiye’de ana sektörlerde iller düzeyinde yapılan kamu yatırımları ile illerin ihracat düzeyleri arasındaki uzun dönemli eşbütünleşik ilişkiler araştırılmaktadır. Çalışma literatüre iller ve sektörler düzeyinde Türkiye’nin son 15 yıllık döneminde uzun dönemli ilişkileri tespit etmek üzere yapılmış bir analiz olması özelliği ile katkı yapmayı hedeflemektedir. Çalışmanın temel amacı ise, illerde kamu yatırımları ile ihracat arasında hangi sektörlerde eşbütünleşik ilişkiler olduğunun tespit edilmesiyle uygun bölgesel politika önerilerinin geliştirilmesidir. Bu doğrultuda konunun önemine değinilen giriş bölümünün ardından özellikle son yıllarda yapılmış çalışmaları kapsayan ampirik literatür analizine yer verilmektedir. Ardından veri seti, yöntem ve ampirik bulguların bulunduğu ampirik analiz bölümü yer almaktadır. Son olarak sonuç kısmında ise ampirik bulgular doğrultusunda Türkiye’de bölgesel kamu yatırımları ile ihracat ilişkisi tartışılmakta ve uygun bölgesel politika önerileri geliştirilmektedir. Analiz bulguları Türkiye’de incelenen sektörler ile ihracat arasında bölgesel düzeyde eşbütünleşik ilişkiler olduğunu ortaya koymaktadır.

Anahtar Kelimeler: *Bölgesel Kamu Yatırımları, Bölgesel İhracat, Panel Veri Analizi, Eşbütünleşme.*

Jel Kodu: *F14, R53, R15.*

**COINTEGRATED RELATIONSHIPS BETWEEN SECTORAL PUBLIC INVESTMENTS
AND EXPORTS IN TURKISH PROVINCES**

ABSTRACT

In this study, the long run cointegrated relationships between sectoral public investments and exports are examined for Turkish provinces during 2003 – 2017. In this framework, this study aims to contribute to the related literature by making analyses for last 15 years of Turkish provinces. Followingly, the main purpose of this study is to enhance regional policy implications for Turkey by detecting long term relationships of public investments and exports. Accordingly, after a short

* Ege Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi İktisat Bölümü, İzmir, burcu.turkcan@ege.edu.tr , Tel: 0232 311 52 98

introduction, a literature analysis is given. Then empirical analysis is explained with data set, method and results. Lastly, in conclusions, the relationships between sectoral public investments and exports in Turkey are discussed and regional policy implications are enhanced.

Key Words: *Regional Public Investments, Regional Exports, Panel Data Analysis, Cointegration*

Jel Classifications: *F14, R53, R15.*

1.GİRİŞ

1950li yıllardan bu yana kamu yatırımlarının bölgelerarası eşitsizliklerin azaltılması ve bölgesel gelişme hızının artırılması konularında oldukça sık başvurulan bölgesel kalkınma politikası araçlarından biri olduğu bilinmektedir. Diğer taraftan küreselleşmenin hız kazanmasıyla birlikte Ricardo'nun (1817) savunduğu fiyat ve maliyet avantajlarına dayalı karşılaştırmalı üstünlüklerin yerini Porter'in (1985) önemine atıf yaptığı uluslararası piyasalarda rekabet edebilmeye dayalı rekabetçi üstünlükler almıştır. Bu gelişmelerle eş zamanlı olarak kendi içsel dinamikleri ile bölgelerin gelişmesine dayalı yeni bölgeselcilik akımı da gündeme oturmuştur. Bu bağlamda ticarete rekabetçi üstünlükleri arttıran kamu yatırımları da ulusal ve bölgesel gelişme açısından kritik hale gelmiştir. Ticaret ve kamu yatırımlarının bölgesel düzeyde ilişkisinin önemine binaen hazırlanan bu çalışmada ise 2003 – 2017 yılları arasında Türkiye'de ana sektörlerde iller düzeyinde yapılan kamu yatırımları ile illerin ihracat düzeyleri arasındaki uzun dönemli eşbütünlük ilişkileri araştırılmaktadır. Bu kapsamda 81 il, 15 yıl ve 5 sektörü kapsayan panel veri analizleri uygulanmaktadır. Tarım, madencilik, imalat, enerji, ulaştırma ve haberleşme ile ihracat arasında uzun dönemli ilişkileri tespit etmek üzere her bir sektöre yönelik kamu yatırımları için ayrı ayrı Panel Johansen-Fisher Eşbütünlük Analizi yapılmaktadır. Çalışma literatüre iller ve sektörler düzeyinde Türkiye'nin son 15 yıllık döneminde uzun dönemli ilişkileri tespit etmek üzere yapılmış bir analiz olma özelliği ile katkı yapmayı hedeflemektedir. Çalışmanın temel amacı ise, illerde kamu yatırımları ile ihracat arasında hangi sektörlerde eşbütünlük ilişkileri olduğunun tespit edilmesiyle uygun bölgesel politika önerilerinin geliştirilmesidir. Bu doğrultuda konunun önemini tartışıldığı kısa bir giriş bölümünün ardından bu alanda özellikle son yıllarda yapılmış çalışmaları kapsayan ampirik literatür analizine yer verilmektedir. Ardından veri seti, yöntem ve ampirik bulguların bulunduğu ampirik analiz bölümü yer almaktadır. Son olarak sonuç kısmında ise ampirik bulgular doğrultusunda Türkiye'de son 15 yıllık süreçte bölgesel kamu yatırımları ile ihracat ilişkisi tartışılmakta ve uygun bölgesel politika önerileri geliştirilmektedir.

2.LİTERATÜR ANALİZİ

Ampirik literatür incelendiğinde kamu yatırımları ile dış ticaret arasındaki ilişkiyi bölgesel düzeyde inceleyen çok fazla çalışma karşımıza çıkmamaktadır. Sektörel kamu yatırımları ekseninde literatür incelendiğinde ise ampirik çalışma sayısı daha da azalmaktadır. Söz konusu alanda kamu yatırımlarının sektörel etkilerini inceleyen bölgesel çalışmalara bakıldığında Hulten ve Schwab (1991)'in çalışması öncü bir çalışma olarak karşımıza çıkmaktadır. 1970 – 1986 döneminde ABD bölgelerini kapsayan bu çalışmanın analizleri sonucunda, kamu yatırımlarının imalat sanayi üretkenliğini bazı bölgelerde daha hızlı arttırdığına yönelik sonuçlar elde edilmiştir. Bir diğer çalışma olarak Kim ve Lee (2002) çalışmasında da yine ABD bölgeleri için 1969 – 1986 zaman aralığında yapılan ampirik analizler sonucunda, kamu yatırımlarının imalat sanayiinde çıktı düzeyinde anlamlı etkilere yol açtığı olgusuna ulaşılmıştır. Fujii vd. (2013) ise 1983 yılı 2. çeyreği ile 2008 yılı 1. çeyreği arasında Japonya'da kamu yatırımlarının tarım, madencilik, inşaat, imalat, toptan ve perakende ticaret, ulaştırma-haberleşme ve hizmetler sektörlerindeki etkilerini ampirik olarak analiz etmişlerdir. Elde edilen bulgular kamu yatırımlarının bazı sektörlerde özel yatırımları dışlama etkisi yarattığı ancak bazı sektörlerde de olumlu etkilere yol açtığı şeklinde olmuştur. Öte yandan bu çalışma bölgesel değil ulusal bir analiz olma özelliği taşımaktadır.

Türkiye için konuyu araştıran çalışmalara bakıldığında ise Çakmak ve Erden (2004) çalışmasında Türkiye'nin 12 bölgesi için 1991-2000 dönemine ait panel veri analizi sonuçları verilmektedir. Temel bulgular; kamu yatırımlarının gelişmiş bölgelerde özel sektör yatırımlarında dışlayıcı etki yarattığı, ancak geri kalmış bölgelerde tamamlayıcı etki yaratarak üretime katkı yaptığı yönündedir. Bir başka çalışma olarak Karadağ vd. (2004), 1980 – 2000 döneminde Türkiye'nin 7 coğrafi bölgesinde kamu yatırımlarının özel sektör imalat sanayi üzerindeki etkilerini araştırmıştır. Vektör Otoregresyon (VAR) modellemesi sonucunda, Karadeniz ve Akdeniz bölgeleri haricindeki bölgelerde ve Türkiye genelinde kamu yatırımlarının özel sektör imalat sanayi çıktılarını olumlu etkilediği sonucuna varılmıştır. Deliktaş vd. (2009) çalışması ise 1980 – 2000 döneminde Türkiye'nin yine 7 coğrafi bölgesinde kamu yatırımlarının özel sektör imalat sanayi üzerine yayılma etkilerini VAR modellemesi ile araştırmıştır. Ampirik bulgular, kamu yatırımları ile özel sektör imalat sanayi üretimi arasında uzun dönemli eşbütünleşik ilişki olduğunu göstermiştir. Uygulanan VAR modeli sonucunda ise bölgelerin çoğunda kamu yatırımlarının dolaylı etkileri pozitif iken, bazı bölgelerde doğrudan etkilerin pozitif olduğu görülmüştür. Öte yandan Güney Doğu Anadolu Bölgesi'nde kamu yatırımlarının imalat sektörü üzerine negatif yayılma etkilerinin geçerli olduğu da gözlenmiştir. Coşar ve Demir (2016) çalışmasında ise taşımacılığa yönelik kamu yatırımlarının uluslararası piyasalara bölgelerin erişimini kolaylaştırdığının altı çizilerek yol yapımına yönelik kamu yatırımlarının illerin ticaret performansları üzerine etkisi analiz

edilmiştir. 2003 – 2012 zaman aralığında illerde yol yapımına yönelik kamu yatırımları ile illerin ihracat ve ithalat verilerinin kullanıldığı çalışmada 22 farklı imalat sanayi endüstrisi incelenmiştir. Panel veri analizi sonucunda ise yol yapımına yönelik kamu yatırımlarının imalat sanayi endüstrilerinde ticari rekabetçiliği arttırdığı bulgusu elde edilmiştir. Yeni bir çalışma olarak Türkcan (2018) çalışmasında ise Türkiye’de iller düzeyinde sektörel kamu yatırımları ile ihracat arasındaki ilişkiler 2003 – 2017 dönemi için Panel Granger Nedensellik Yöntemi ile incelenmiştir. Temel bulgular, ihracatın ulaştırma-haberleşme ve enerji sektörlerindeki kamu yatırımları artışının nedeni olduğu; imalat sektöründe ise kamu yatırımları ile ihracat arasında karşılıklı nedensellik ilişkisi bulunduğu yönünde olmuştur.

Görüldüğü üzere ilgili literatürde sektörel kamu yatırımları ile dış ticaret ilişkisini Türkiye’de iller düzeyinde son yıllar için araştıran bir çalışma bulunmamaktadır. Daha önce yapılmış benzer çalışmalar ya daha büyük coğrafi bölgeler düzeyinde konuyu ele almakta ya da kamu yatırımları ile üretim, üretkenlik ilişkileri ekseninde konuyu incelemektedirler. Bu çalışmaya en yakın çalışma Türkcan (2018) çalışması olmakla birlikte bu çalışmada sadece nedensellik araştırması yapılmış, uzun dönemli eşbütünlük ilişkilerin varlığı araştırılmamıştır. Dolayısıyla bu çalışma kapsamında uygulanmakta olan analizin Türkiye’de en güncel veriler ışığında 81 il düzeyinde sektörel kamu yatırımları ile bölgesel ihracat performansı arasındaki uzun dönemli eşbütünlük ilişkilere dair bulgular sunması açısından literatüre katkı yapması beklenmektedir.

3. AMPİRİK ANALİZ

3.1. Veri Ve Yöntem

Bu çalışmada kullanılan kamu yatırımlarına dair veriler Türkiye Cumhuriyeti Kalkınma Bakanlığı’nın veri tabanından temin edilmiştir. Veriler 81 il ve 10 sektör düzeyinde yayınlanmış olup sektörler; tarım, madencilik, imalat, enerji, ulaştırma ve haberleşme, turizm, konut, eğitim, sağlık ve diğer kamu yatırımları toplamı olarak sınıflandırılmıştır. Bu çalışmada enflasyon etkilerinden arındırma amaçlı olarak sabit fiyatlar cinsinden yayınlanan kamu yatırımları verileri kullanılmıştır. Söz konusu veriler ihracat verileri ile uyumlandırma amaçlı olarak da Türkiye Cumhuriyeti Merkez Bankası’nın (TCMB) veri tabanından elde edilen yıllık ortalama ABD doları döviz kurları kullanılarak dolara çevrilmiştir. İllere göre ihracat verileri ise yine 81 il için ABD doları cinsinden Türkiye İstatistik Kurumu (TÜİK) veri tabanından temin edilmiştir. Sonuç olarak çalışmada kullanılan veri setleri 81 il ve 15 yıldan oluşan 6 adet panel veri setidir. Tüm veri setlerine dair zaman aralığı 2003 – 2017 dönemidir. Tüm bunların yanısıra Kalkınma Bakanlığı’nın kamu yatırımları açısından kullandığı sektör sınıflamasında turizm, konut, eğitim ve sağlık sektörleri analiz dışında bırakılarak dış ticaret ile daha

doğrudan ilişkili olan tarım, madencilik, imalat, enerji, ulaştırma ve haberleşme sektörlerine dair veri setleri kullanılmıştır.

3.2. Uygulama

Bilindiği üzere ekonometrik analizlerde serileri analize dâhil etmeden önce durağanlık durumlarının araştırılması özel önem arz etmektedir. Bu bağlamda sahte regresyon tuzağına düşmemek ve hatalı tahminleme sonuçları elde etmemek için öncelikle serilere birim kök testleri uygulanarak durağanlık durumlarının araştırılması gerekmektedir (Sevüktekin & Nargeleçekenler, 2005: 277). Her ne kadar eşbütünleşme analizlerinde kimi zaman durağan olmayan seriler ile çalışılabilir de genel eğilim, durağan veya durağanlaştırılmış seriler ile çalışmak yönündedir. Zaman serilerinde çoğunlukla Augmented Dickey Fuller (ADF) Birim Kök Testi yeterli görülmeyle birlikte, panel veri analizlerinde farklı sıfır hipotezlerine sahip birden fazla birim kök testinin serilere uygulanması ve test sonuçlarının çoğunluğuna göre serilerin durağanlığına karar verilmesi yaklaşımı esastır. Bu bağlamda bu çalışmada da analize konu olan serilere 4 ayrı birim kök testi uygulanmıştır. Tablo 1’de bu çalışmaya konu olan 6 seri için 4 birim kök testinin sonuçları bulunmaktadır.

Tablo 1. Serilerin Düzey Değerlerine Uygulanan Panel Birim Kök Testleri Sonuçları

| | İmalat | Enerji | Madencilik | Tarım | Ula-Hab | İhracat |
|------------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| Levin, Lin & Chu t | 274,764 (1,000) | -2,50314 (0,006)*** | -9,95457 (0,000)*** | -8,56376 (0,000)*** | -4,00595 (0,000)*** | -3,38403 (0,000)*** |
| Im, Pesaran and Shin W-stat | -7,80409 (0,000)*** | -6,08563 (0,000)*** | -9,95457 (0,000)*** | -3,68709 (0,000)*** | -2,91038 (0,001)*** | 1,49740 (0,932) |
| ADF - Fisher Chi-square | 217,858 (0,000)*** | 266,826 (0,000)*** | 274,362 (0,000)*** | 233,036 (0,000)*** | 205,383 (0,011)** | 131,499 (0,962) |
| PP - Fisher Chi-square | 420,290 (0,000)*** | 311,503 (0,000)*** | 401,219 (0,000)*** | 210,795 (0,006)*** | 303,296 (0,000)*** | 153,255 (0,676) |

Not: * %10 düzeyinde istatistiki anlamlılık; **%5 düzeyinde istatistiki anlamlılık; ***%1 düzeyinde istatistiki anlamlılık

Tablo 1’deki sonuçlardan görüldüğü üzere ihracat serisinde birim kök sorunu bulunmaktadır. Zira 4 testin 3’ünün sonuçları birim kök problemine işaret etmektedir. Analize devam edebilmek için durağan olmayan serilerin durağanlaştırılması gerekmektedir. Dahası analizde ihracat serisi ile diğer serilerin eşbütünleşik ilişkileri ikişer ikişer araştırılacağı için ve bir ekonometrik analizde analize konu olan serilerin tümünün aynı düzeyden entegre olması gerektiği için tüm serilerin farkını alma yoluna gidilmesi gerekmektedir. Bu nedenle tüm serilerde birinci farkları alınarak birim kök testleri yeniden uygulanmış ve sonuçlara Tablo 2’de yer verilmiştir.

Tablo 2. Serilerin Birinci Farkları Alındıktan Sonra Uygulanan Panel Birim Kök Testleri Sonuçları

| | İmalat | Enerji | Madencilik | Tarım | Ula-Hab | İhracat |
|------------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| Levin, Lin & Chu t | 360,268 (1,000) | -8,01453 (0,000)*** | -21,4978 (0,000)*** | -15,7996 (0,000)*** | -17,6056 (0,000)*** | -11,5884 (0,000)*** |
| Im, Pesaran and Shin W-stat | -20,0432 (0,000)*** | -17,6291 (0,000)*** | -16,3419 (0,000)*** | -13,0186 (0,000)*** | -14,8739 (0,000)*** | -9,12814 (0,000)*** |
| ADF - Fisher Chi-square | 546,522 (0,000)*** | 543,829 (0,000)*** | 566,159 (0,000)*** | 469,955 (0,000)*** | 528,520 (0,000)** | 385,370 (0,000)*** |
| PP - Fisher Chi-square | 1112,57 (0,000)*** | 944,161 (0,000)*** | 1279,59 (0,000)*** | 886,614 (0,000)*** | 1071,24 (0,000)*** | 716,506 (0,000)*** |

Not: * %10 düzeyinde istatistiki anlamlılık; **%5 düzeyinde istatistiki anlamlılık; ***%1 düzeyinde istatistiki anlamlılık

Tablo 2deki sonuçlardan görüldüğü üzere tüm serilerin birinci farkları alındığında seriler durağan hale gelmektedir. Dolayısıyla tüm serilerin birinci farkları kullanılarak panel eşbütünlük ile analize devam etmek uygun görünmektedir.

Panel eşbütünlük analizi temel olarak değişkenler arası uzun dönemli ilişkileri analiz etmek üzerine kurulu metotları kapsar ve kökleri Engel ve Granger'ın (1987) çalışmasına dayalıdır. Söz konusu çalışmayı takiben Johansen (1988), Pedroni (1995, 1997, 2000), Westerlund (2005) gibi çalışmalar ışığında panel eşbütünlük analizi zaman içinde geliştirilmiştir. Son dönemde ise Johansen-Fisher Panel Eşbütünlük Testi, diğer bir deyişle Fisher (1932) nonparametrik istatistiki bulgularına dayalı Johansen Testi yaygın olarak kullanılmaktadır. Tablo 3'te bu çalışma kapsamında illerde söz konusu zaman aralığı için ihracat ile sektörel kamu yatırımları arasındaki uzun dönemli ilişkileri gösteren ikili Johansen-Fisher Eşbütünlük Testi Sonuçlarına yer verilmektedir.

Tablo 3. İllerde İhracat ile Sektörel Kamu Yatırımlarına Dair Eşbütünlük İlişkiler

| Kısıtlanmamış Sıra Eşbütünlük Testi (İz ve Maksimum Özdeğer) | | | | |
|--|------------------------------------|----------|--|----------|
| İhracat ve İmalat Kamu Yatırımları | | | | |
| Hipotezi Kurulmuş Eşbütünlük İlişkilerin Sayısı | Fisher İstatistiği* (İz testinden) | Olasılık | Fisher İstatistiği* (Maks-özdeğer testinden) | Olasılık |
| Hiç | 744.1 | 0.0000 | 558.9 | 0.0000 |
| En Fazla 1 | 486.8 | 0.0000 | 486.8 | 0.0000 |
| Kısıtlanmamış Sıra Eşbütünlük Testi (İz ve Maksimum Özdeğer) | | | | |
| İhracat ve Enerji Kamu Yatırımları | | | | |
| Hipotezi Kurulmuş Eşbütünlük İlişkilerin Sayısı | Fisher İstatistiği* (İz testinden) | Olasılık | Fisher İstatistiği* (Maks-özdeğer testinden) | Olasılık |
| Hiç | 910.3 | 0.0000 | 706.3 | 0.0000 |
| En Fazla 1 | 588.6 | 0.0000 | 588.6 | 0.0000 |
| Kısıtlanmamış Sıra Eşbütünlük Testi (İz ve Maksimum Özdeğer) | | | | |

| İhracat ve Madencilik Kamu Yatırımları | | | | |
|---|------------------------------------|----------|--|----------|
| Hipotezi Kurulmuş Eşbütünleşik İlişkilerin Sayısı | Fisher İstatistiği* (İz testinden) | Olasılık | Fisher İstatistiği* (Maks-özdeğer testinden) | Olasılık |
| Hiç | 810.1 | 0.0000 | 587.8 | 0.0000 |
| En Fazla 1 | 588.9 | 0.0000 | 588.9 | 0.0000 |
| Kısıtlanmamış Sıra Eşbütünleşme Testi (İz ve Maksimum Özdeğer) | | | | |
| İhracat ve Tarım Kamu Yatırımları | | | | |
| Hipotezi Kurulmuş Eşbütünleşik İlişkilerin Sayısı | Fisher İstatistiği* (İz testinden) | Olasılık | Fisher İstatistiği* (Maks-özdeğer testinden) | Olasılık |
| Hiç | 750.6 | 0.0000 | 554.6 | 0.0000 |
| En Fazla 1 | 540.7 | 0.0000 | 540.7 | 0.0000 |
| Kısıtlanmamış Sıra Eşbütünleşme Testi (İz ve Maksimum Özdeğer) | | | | |
| İhracat ve Ulaştırma-Haberleşme Kamu Yatırımları | | | | |
| Hipotezi Kurulmuş Eşbütünleşik İlişkilerin Sayısı | Fisher İstatistiği* (İz testinden) | Olasılık | Fisher İstatistiği* (Maks-özdeğer testinden) | Olasılık |
| Hiç | 775.4 | 0.0000 | 564.0 | 0.0000 |
| En Fazla 1 | 570.3 | 0.0000 | 570.3 | 0.0000 |

Not: * Olasılıklar asimptotik Ki-Kare dağılımı kullanarak hesaplanmıştır.

Tablo 3'teki tüm iz testi ve maksimum özdeğer testi sonuçları sektörel kamu yatırımlarının tüm çeşitleri ve ihracat arasında söz konusu 15 yıllık dönemde eşbütünleşik ilişkiler olduğunu gözler önüne sermektedir.

4.SONUÇ VE TARTIŞMA

Bilindiği üzere ekonomide toplam talebi ve uzun dönem büyümesini belirleyen en önemli unsurlardan biri yatırım harcamalarıdır (Narin, 2013: 245). Özellikle 1980lerde içsel büyüme modellerinin ön plana çıkmasıyla birlikte kamu yatırımları ile ekonomik büyüme ve gelişme arasındaki ilişki üzerine daha fazla araştırma yapılmaya başlanmıştır. Bu kapsamda Barro (1990) kamu harcamalarının ekonomide artan getirilere yol açtığı bir büyüme modeli kurgulayarak kamu yatırımlarını büyüme modellerine, özel öneme sahip bir faktör olarak eklemiştir. Aynı yıllarda küreselleşmenin de hız kazanmasıyla uluslararası piyasalarda rekabetçilik ekseninde karşılaştırmalı üstünlükler yaklaşımının yerini rekabetçi üstünlükler almıştır. Krugman'ın (1991) geliştirdiği Yeni Ekonomik Coğrafya yaklaşımı ile de kamu yatırımlarının özellikle taşımacılık ve ulaştırma alanlarındaki önemine dikkatler çekilmiştir. Tüm bu gelişmeler bağlamında, son yıllardaki bölgeselleşme akımının da etkisiyle, bölgelerde kamu yatırımları ile dış ticaret ilişkisi üzerine araştırmalar hız kazanmıştır. Son yıllarda ABD ve Japonya gibi ülkeler için yapılmış bu tip çalışmalar dikkat çekmekle birlikte Türkiye'de ilgili alanda özellikle bölgesel çalışmalar konusunda çok az sayıda araştırmanın yapıldığı görülmektedir. Bu bağlamda bu çalışma, Türkiye'nin son 15 yıllık döneminde İstatistik Bölge Birimi Sınıflandırmasına göre 3. Düzey bölgeler olarak da ifade edilen illerde sektörel kamu yatırımları ile ihracat arasındaki uzun

dönemli ilişkileri analiz etmeyi amaçlamaktadır. Yapılan eşbütünleşme analizleri sonucunda imalat, enerji, madencilik, tarım ve ulaştırma-haberleşme ile ihracat arasında söz konusu dönemde 81 il kapsamında eşbütünleşik ilişkilerin geçerli olduğu görülmektedir. Dolayısıyla Türkiye’de kamu yatırımlarının incelenen tüm sektörlerde dış ticaret ile ilişkili olduğunu söylemek mümkündür. Bu bağlamda devletin tüm bu sektörlerde kamu yatırımlarını arttırıcı adımlar atması gerekliliği görülmektedir. Her ne kadar Türkiye’de bazı bölgelerde kamu yatırımlarının özel yatırımları dışlayıcı etkisi olduğuna değinen Çakmak ve Erden (2004) çalışması mevcut olsa da Karadağ vd. (2004), Deliktaş vd. (2009) gibi çalışmalar da kamu yatırımlarının özel sektör üretkenliği üzerine pozitif etkileri olduğu bulgularına sahiptir. Ayrıca bu çalışmaların illerden ziyade coğrafi bölgeler düzeyinde analizlerini yapmış olduklarını da unutmamak gereklidir. Diğer yandan dikkat çekici bir nokta olarak Türkcan (2018) çalışmasındaki bulguların Türkiye’de aynı dönemde iller düzeyinde tarım ve madencilik sektörlerinde ihracat ile herhangi bir nedensellik ilişkisi bulunmadığına işaret etmesidir. Öte yandan bu çalışmada bu sektörlerde de uzun dönemde eşbütünleşik ilişkiler tespit edilmiştir. Burada iki ihtimal karşımıza çıkmaktadır. Ya bu seriler tesadüfi olarak uzun dönemde birlikte hareket etmektedir ya da küresel finans krizi gibi bir yapısal kırılma serilerde hareket değişikliğine yol açmıştır. Dolayısıyla bir adım öteye giderek analizleri yapısal kırılmalı birim kök ve yapısal kırılmalı eşbütünleşme analizleri ekseninde geliştirmek faydalı olabilir.

Diğer taraftan mevcut bulgular ekseninde yorum yapılacak olursa; özellikle bölgesel gelişmişlik farklılıklarının bu kadar keskin olduğu ülkemizde kamunun iller düzeyinde dış ticarete yönelik sektörlerde yatırımlarını yoğunlaştırması, illerin uluslararası piyasalarda rekabetçiliğini arttırmaya destek olacağı gibi bölgesel gelişmişlik farklılıklarını azaltmaya da yardımcı olacaktır. Bu bağlamda illerin rekabetçi oldukları sektörlerde yatırımların yoğunlaştırılması ve bu yolla ihracatın artırılması uygun bir politika seçeneği gibi görünmektedir. Bu noktada bölgesel kalkınma ajanslarının etkin çalışmaları ve yatırımları doğru alanlara yönlendirmek üzere etkin rehberlikleri özel önem arz etmektedir. Söz konusu yatırımların ihracatçı sektörlerle yönlendirilmesi yoluyla ihracat-yanlı büyüme modeli ekseninde uzun dönemli büyüme hedefi doğrultusunda bir adım atmak mümkün görünmektedir.

KAYNAKÇA

Barro, R.J. (1990) “Government Spending in a Simple Model of Endogenous Growth”. *Journal of Political Economy*, 98, 103-125.

Celebioglu, F. ve Dall’erba, S. (2010) “Spatial Disparities Across the Regions of Turkey: an Exploratory Spatial Data Analysis”, *Annual Regional Sciences*, 45: 379 - 400.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Coşar, A. K. ve Demir, B. (2016) “Domestic Road Infrastructure and International Trade: Evidence from Turkey”, *Journal of Development Economics*, 118: 232 – 244.

Çakmak, H.K. ve Erden, L. (2004) “Yeni Bölgesel Kalkınma Yaklaşımları ve Kamu Destekleme Politikaları: Türkiye’den Bölgesel Panel Veri Setiyle Ampirik Bir Analiz”, *Gazi Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 6(3): 77 - 96.

Deliktaş, E., Önder, A.Ö. ve Karadağ, M. (2009) “The Spillover Effects of Public Capital on the Turkish Private Manufacturing Industries in the Geographical Regions”, *Annual Regional Sciences*, 43: 365 – 378.

Engel, R.F. ve Granger, C.W.J. (1987) “Cointegration and Error-Correction: Representation”, *Estimation and Testing*, *Econometrica*, 55: 251- 276.

Fisher, R.A. (1932) “Statistical Methods for Research Workers”, 4th Edition. Edinburgh: Oliver and Boyd.

Fujii, T., Hiraga, K. ve Kozuka, M. (2013) “Effects of Public Investment on Sectoral Private Investment: A Factor Augmented VAR Approach”, *Journal of the Japanese and International Economies*, 27: 35 - 47.

Hulten, C.R. and Schwab, R.M. (1991) “Public Capital Formation and the Growth of Regional Manufacturing Industries”, *National Tax Journal*, 44(4): 121 – 134.

Johansen, S. (1988). *Statistical Analysis of Cointegrating Vectors*. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 12, 231 – 254.

Karadağ, M., Deliktaş, E. ve Önder, A.Ö. (2004). The Effects of Public Capital on Private Sector Performance in Turkish Regional Manufacturing Industries, *European Planning Studies*, 12(8): 1145 – 1156.

Kim, S. ve Lee, Y.H. (2002) “Public Sector Capital and the Production Efficiency of U.S. Regional Manufacturing Industries”, *The Japanese Economic Review*, 53(4): 466 – 477.

Narin, M. (2013) “Türkiye’de Yatırım Teşvikleri, Türkiye Ekonomisinde Dönüşüm ve Yeniden Yapılanma Arayışları”, Ed. Mert Ural, Dilek Seymen ve Aylin Abuk Duygulu. İzmir: Dokuz Eylül Üniversitesi Yayınları.

Pedroni, P. (1995) “Panel Cointegration: Asymptotic and Finite Sample Properties of Pooled Time Series Tests with and Application to the PPP Hypothesis”, *India University Working Papers in Economics*. No. 95-013.

***ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES***

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Pedroni, P. (1997) “Panel Cointegration: Asymptotic and Finite Sample Properties of Pooled Time Series Tests with and Application to the PPP Hypothesis”, New Results. India University Working Papers in Economics. No. 97.

Pedroni, P. (2000) “Fully Modified OLS for Heterogenous Cointegrated Panels, Nonstationary Panels, Panel Cointegration and Dynamic Panels”, Advances in Econometrics. Ed. Badi H. Baltagi. Amsterdam. 93 – 130.

Porter, M.E. (1985) “Competitive Advantage: Creating and Sustaining Superior Performance”, New York: Free Press.

Ricardo, D. (1817) “On the Principles of Political Economy and Taxation”, Ed. P. Sraffa. Londra

TCMB. Yıllık Ortalama ABD Doları Döviz Kurları. <http://www.tcmb.gov.tr> (08.02.2018).

TÜİK. İllere Göre İhracat. <http://www.tuik.gov.tr> (08.02.2018)

Türkcan, B. (26-28 Nisan 2018) “Sektörel Kamu Yatırımları ile İhracat Arasındaki İlişki: Türkiye için İller Düzeyinde Panel Nedensellik Analizleri”, 1. International Congress of Political, Economic and Financial Analysis. Özet Kitabı. Sayfa 51. [http://www.pefa.org.tr/PEFA-Congress_Abstract-Book\(v.1\).pdf](http://www.pefa.org.tr/PEFA-Congress_Abstract-Book(v.1).pdf)

Türkiye Cumhuriyeti Kalkınma Bakanlığı. Sektörel Kamu Yatırımları. <http://www.kalkinma.gov.tr> (08.02.2018)

Westerlund, J. (2005). “New Simple Tests for Panel Cointegration”. Lund University Working Papers.

**HOUSING POLICIES AND DECISION-MAKING IN URBAN PLANNING PROCESS OF
TURKEY AND RUSSIA**

Elmira NIZAMOVA *

Asuman TÜRKÜN**

ABSTRACT

The empirical research aims to find out similarities and differences between urban planning systems of Turkey and Russia starting from the beginning of the 20th century up to the present. The study focuses on the social housing problem as an essential part of urban life. The decision-making processes and prominent actors in housing policies of Turkey and Russia countries are defined for different periods in Russia and Turkey and compared with European and North American countries' experience in order to find out how these models work within different economic, social and historical contexts. Although the political regimes of Turkey and Russia were different, similarities in the urbanization process are worth analyzing. Moreover, a lot of similarities can be traced in the current housing renovation programs aiming to improve the aging and deteriorated housing stock within cities, which requires taking into account the economic and political conditions in Turkey and Russia today.

The historical view on housing shortage problems, reasons, and previous solutions help to define weak points of precedent housing policies and to analyze their impacts on social life, city fabric, housing itself and housing regulations in a short and long-term perspective. Such an approach also helps to evaluate the current housing policies in order to avoid mistakes in further applications. The outcome of the research is expected to determine a framework of solutions for present housing problems and help to optimize the urban planning decision-making process.

Keywords: *Housing Policy, Decision-Making Actors, Public Housing, Renovation.*

JEL Codes: *R0, R200, R280.*

1.INTRODUCTION

Housing is one of the basic necessities of life that forms the basis for citizens' living conditions. The state of the housing sector reflects the country's economic conditions, social structure, political ideologies, and technological development level. Social housing in this scope is the most straightforward

*Student, Department of Architecture, Yildiz Technical University, Turkey. elfiknizam@gmail.com.

** Prof. Dr., Department of Architecture, Yildiz Technical University, Turkey. asu.turkun@gmail.com

representation of a country's condition, especially, taking into account the fact that 33% of the urban population (World Bank, 2014), which is estimated to be 55% of world's population (World Bank, 2017), lives in slums.

Three breaking points in history could be noted for the development of social housing models and practices. These can be listed as Industrial Revolution, World War II and the Neoliberal era after the 1970s. A rapid urbanization process was experienced parallel to the industrialization process in developed countries like the United Kingdom or the USA or some EU countries starting from the middle of the 19th century. In Turkey and Russia, these processes appeared later at the beginning of the 20th century. A rapid migration from rural to urbanized territories led to the scarcity of housing in such cities. Originated as a solution to the sheltering needs of low-income groups in the city, social housing can be defined as the sheltering service of governments towards the vulnerable population or the houses provided by public institutions or non-profit organizations for low-income people or the citizens that have specific needs (Hazar, 2015). Social housing includes several different models developed under different conditions: communal housing, company town, council housing, public housing, rental housing, affordable housing. Different actors, economic conditions and practices are being involved in these programs (Hazar, 2016).

2. GENERAL COMPARISON AND THE HISTORY OF HOUSING POLICIES IN TURKEY AND RUSSIA.

To start with, some general data related to the housing policies of these countries have been compared. According to the latest data, Turkey and Russia have some obvious similarities. The table below shows that both Russia and Turkey have approximately the same urbanization ratio, quite similar GNI per capita and living cost index. Furthermore, both countries have a huge amount of dilapidated, risky or low-quality housing stock within the cities which has to be demolished and renovated according to representatives' claims (Moscow Mayor Official Website, 2018; TMMOB, 2017).

Table 9. General Comparison of Turkey and Russia

| | Turkey | Russia |
|---|---|--|
| Population | 82,374,967 (Worldometers, 2018) | 143,955,017 (Worldometers, 2018) |
| GNI per capita | 10,930 (World Bank, 2017) | 9,230 (World Bank, 2017) |
| Urbanization | 72.1 % 59,060,906 people (Worldometers, 2018) | 72,8% 104,741,046 people (Worldometers, 2018) |
| Urban population growth (annual%) | 2,2 (2017) ↗ | 0,3 (2017) ↗ |
| Total housing stock | 22,206,776 buildings (TurkStat, 2017) | 3,724,000,000 m² (RosStat, 2018) |
| Unemployment ratio | 11.1% ↗ (World Bank, 2018) | 4,5% ↘ (World Bank, 2018) |
| Poverty headcount ratio at national poverty lines (% of population) | 1,6% ↗ (UN Data, 2015) | 13,2% ↘ (UN Data, 2016) |
| Cost of living index | 35.52 (Numbeo, 2018) | 36.73 (Numbeo, 2018) |
| Migration rate for year 2017 (x=immigrants-emigrants) | 212 693 people ↗ (TurkStat, 2018) 0,25% | 211 878 people ↘ (RosStat, 2018) 0,14% |
| Risky and dilapidated housing stock | -Shanties – approximately 12% (World Bank, 2017); -Lack of occupancy permit – approximately 67% (TOKI, 2018); -Risky building – approximately 40% (Ministry of Environment and Urbanization, 2016) (around 7mln buildings) | -Risky and dilapidated – approximately 11,544,400 m² 3,1% (RIA-Analytics, 2017) -Five-floor houses built in 1957-1964 years “khrushchevki”- approximately 10% (The Moscow Times, 2017) |

Beyond doubt, there are significant differences between the countries. The unemployment rate in Turkey (11,1%) is more than twice higher than in Russia (4,5%) and tends to rise. The poverty rate of Turkey estimated as only 1,6% is considerably lower than in Russia, however, it is expected to rise in the circumstances of the existing economic situation. On the other hand, despite the fact that the unemployment rate in Russia is lower (4,5%), poverty headcount ratio at national poverty lines is significantly higher than in Turkey. In addition, the migration rate in Turkey is almost twice higher than in Russia, however the statistical data takes into account only officially registered migrations while the amount of illegal immigrants in Russia counts up to 2,6 million people nowadays and tends to decrease (MVD, 2018) while in Turkey the number of illegal immigrants crossing the country gradually increased since 2013 (Hurriyet, 2018). Most of the immigrants prefer to live in central cities like Moscow in Russia and Istanbul in Turkey seeking for better living conditions, which adds an extra load on the cities' infrastructure, social stress and also boosts the housing problem.


Both countries have governmentally supported programs of social housing for citizens. In Russia, social housing programs operate within the framework of the “Government Decree of 2014 under the number 404” of Federal regulations; however particular applications differ according to local government's arrangements of the budget and programs being applied. But the lack of social housing stock and unequal provision of governmental social programs obstruct the applications. (The Russian Government, 2018). In comparison, in Turkey, all the social housing development is being managed by

the Housing Development Administration of Turkey (TOKI), which manages the social housing production mechanism from 1984 from a single source. (Arslan, 2014; Turkun, 2011, 2015).

To understand the differences in the proportions of risky and dilapidated housing stock and the reasons of its formation, it is necessary to focus on the history of housing policies in the Republic of Turkey and Russian Federation (Soviet Union former).

Table 2. Housing Policies Development in Turkey and Russia

| Years | Turkey | Russia |
|-------|---|---|
| 1920 | <p>1923 - establishment of the Republic of Turkey → "radical modernity" path of development → rapid change in economic, political, social life (socialist urban implementations as a design tool of modern, secularist society.</p> <p>Industrialization and, transportation development → factory (coal/iron and textile) construction in small towns on the railway paths (worker settlements with housing for engineers and workers, social premises) → urbanization and modernization.</p> <p>Co-operative development model emerge → the beginning of mass-housing production with help of bank loans. → Housing units that were organized by the same professional groups together on the lands provided by local and central authorities. New-built house quarters were built with required infrastructure like school, public places etc. The plan design differed from place to place (from rather traditional Turkish architecture to modernist functional design.</p> | <p>1917 - October Revolution → rapid change in economic, political, social life → chaos, economic crisis</p> <p>1922 - USSR was formed → mechanization of rural territories, industrialization around new built factories, etc. → migration from rural to urban settlements starts.</p> <p>Property of ex-bourgeoisie become state-owned → 1918 decree "On Abolition of Private Property in Cities" and "On Land Socialization" → state allocates dwelling among citizens → rise of communal apartments.</p> <p>Developing a model of a standard house in accordance with modern requirements and with the use of a scientific approach (research offices, contests, projects, experiments).</p> <p>The low-rise development model or a "garden city": Modest but comfortable houses built by several standard projects invented by the State Office, were owned by 1-2-4-6 families, had garden plots.</p> |
| 1930 |  <p>The model of the company towns was designed with dense public spaces where the workers and public officials could socialize. (Actors: central administration, state-owned enterprises, architects, urban planners, some private enterprises and some foreign countries). Focus on the sociocultural development of the individual and acceleration in the modernization of cities by providing public spaces.</p>  | <p>Collectivization → migration from rural to urban settlements for a better life.</p> <p>Mid-rise development model → Functional zoning values in urban planning, functionalism in architecture and design → socialist "micro district" development → new standards in urban planning and architecture. → "stalinki" – 5-8 floor blocked mass housing, orthogonal masterplans and classical, simple but detailed architecture, high ceilings, small apartments, facilities in yards or walking distance, insulation.</p>  <p>1935 – a new masterplan of Moscow → Social realism representation → wide straight boulevards and streets, monumental public buildings, bigger scale, higher buildings (these ideas spread to all the country).</p> |

| | | |
|------|---|--|
| 1945 | <p>After the Second World War → Rapid after-war industrialization → decline in agriculture → a rapid increase in migration from rural settlements to urban areas → start of uncontrolled urban sprawl, slums, squatters.</p> | <p>After the Second World War → lack of housing and money, an extreme shortage of dwelling. A short-term of low-rise model return (Germany, Poland inspired, were built on outskirts mostly). Rather European-looking but considerably small flat blocks.</p> |
| 1950 | <p>Public state housing model → the state or lodging houses provided by public institutions for their workers for rent or free.</p>  <p>1956 - Development Law → common standards were abolished, each city was given the freedom to plan according to its own conditions.</p> <p>Intensive urbanization → a need for urban and regional planning on a higher scale because of transportation and illegal housing, (squatters) problem. → 1958 The ministry of public works and settlements was established. It took responsibility for the formulation of the general framework of urban planning -shaping and housing strategy → Historic buildings were demolished to open roads of 30 and 50 meters wide, some squares turn into roads and pedestrian areas are left to cars.</p> |  <p>Prefabricated mass housing → Aim to provide as much housing as possible in a short time and as cheap as it could be → researches, new minimal regulations for housing → “khrushchevki” – 5-floor prefabricated cheap housing with “existence minimum” values (German experiments inspired +France, Holland Sweden after-war mass housing). Houses could be built in 15 days, had tiny apartments, low ceiling, inner yards with all facilities. 20-50-year lifespan.</p>  |
| 1960 | <p>A fight to squatters and shanties → The informal settlements, that are rapidly spreading and leading to important economic, social and political problems, have been tried to be legitimized by the governments.</p> | <p>1970 - a new masterplan of Moscow was announced → rise in scale (transportation, houses).</p> |
| 1970 | <p>1963 - “A First development plan”; 1966 - “A shanty law No. 775” → a start to legislation of squatters.</p> <p>1965 - An Ownership law – increases speculation on plot by build-and-sell applications.</p> | <p>→ High-rise development model – development and modifications of previous layouts and rise in variety of prefabricated elements, rise in height (9, 16 floors) and comfort of the houses → new more spacious measures of standards → Improved prefabricated mass housing.</p> |
| 1980 | <p>1981 - “A Mass Housing law” No. 2985 1983 – “Expropriation Law” No. 2942</p> <p>1983 – First announcement of “An Amnesty law” → led to legislation of squatters, loss of property control by governments, aimed to incline citizens during pre-election periods.</p> |   |
| 1990 | <p>1984 - Turkish Mass Housing Administration (TOKI) establishment (a spread of cooperative development model) → accelerated mass housing provision in the country.</p> <p>The 1999 Marmara earthquake -150,000 houses were heavily damaged → 300,000 people were left homeless → new construction standards → a requirement of reconstruction of risky and dilapidated housing and squatters; evacuation zones organization (using open public spaces inside the city) → RP</p> | <p>1991 - the collapse of USSR → chaos in legislation, lack of state regulation → continuation and adaptation of soviet housing regulations to new free market realities.</p> <p>Privatization → problems in responsibility for infrastructure around new built houses.(state or owners). → many houses are built into existing microdistricts without public services → overload of infrastructure → new improved planning and construction regulations.</p> <p>Rise of social inequality → Rise of the gap between social and elite housing.</p> |
| 2000 | | <p>New construction systems → variety of housing stock.</p> |

| | | |
|-------------|---|--|
| <p>2010</p> | <p>2005 Municipality Law No. 5393 → municipalities are authorized to implement urban regeneration and renewal projects.</p>  <p>After several changes in regulations and laws TOKİ as a central government organization became the main actor in the housing sector in Turkey. → social housing can be made only by TOKİ.</p> <p>2012 “The Law on the Regeneration of Areas under Disaster Risk, No. 6306” → the law legislated urban renewal projects. In fact, most of the projects led to poor quality, dense and commercialized mass housing projects in the most profitable areas inside the cities.</p> | <p>Housing stock built in 1940-1970 (mostly “khrushchevki”, and dilapidated earlier series) require solutions → Development and state + developers based investment of the programs of overhaul, renovation, renewal of risky and dilapidated housing stock. (“The housing” federal resettlement program 2002-2017, 2019-...; “The program of Renovation of Moscow” 2017-2022, local resettlement programs) → reconsidering the standards of new-built housing.</p>  |
|-------------|---|--|

Both countries have the same reason of rapid urbanization starting from the beginning of the 20th century with the formation of the Soviet Union in 1917 and the establishment of the Republic of Turkey. There were significant changes in political, economic, and social life; but what is more important is the ideological changes related to the vision of how people should live. Both countries took a path of modernization in order to introduce new values to society. However, Turkey operated in the scope of private (individual, shared, local and international companies) and state property while in USSR all the private property was abolished and all the real estate was managed by the state. Therefore, each state developed their own models of housing provision for their citizens. In Turkey “co-operative development model”, “the model of the company towns” and “the model of public state housing” emerged (Hazar, 2016). USSR developed “low-rise”, “mid-rise” and “high-rise” development models (Bronovitskaya, 2018). Different actors took decisions on social housing development: statecooperatives (companies), banks, specialists in Turkey; state and specialists in USSR (after 1991, plus developers and banks). What makes these approaches similar is that they were inspired by modernistic views of European urban planners and architects. Soviet architects developed their own system of regulations for urban planning and design inspired by Le’ Corbusier’s ideas and some experiments and applications from Germany, Poland, France, and the UK. Turkey had a more variable approach when architects from European countries like Germany and France were invited to make projects for particular social projects or local architects worked under the inspiration of modernistic views spread from Europe during that period.

The comparison between after-war housing policies of these countries shows that if in Turkey the most crucial issues were related to construction management and control (reduction of squatters,



shanties, and illegal construction) and earthquake threat (after the 1999 Marmara earthquake), in Russia the most problematic issues originated from low-quality aging housing stock (Housing stock built in 1940-1970, mostly “khrushchevki”) which were considered as a temporary shelter for citizens but still being used. Owing to the 70-years state-owned property experience and urban planning practice which started from the 1920s in the Soviet Union, Russia nowadays has a comprehensive and hierarchical urban planning and regulation system. Whilst in Turkey, “The Development Law” (1956) and later “Municipality Law No. 5393 which let local authorities develop territories according to their specific conditions combined with property ownership complexity (especially on squatted areas) and market-oriented development led to fragmented applications in urban planning. A long history of property ownership resulted in a wide variety of property types in Turkey compared to Russia. However, “The Amnesty law” announced firstly in 1983 and re-announced later several times (the last one was announced in 2017) led to the regularization of squatters and aggravated the loss of property control by governments on squatters’ territories (Cakir, 2011). In addition, the intrusion of neoliberalism in Turkey after the 1980s, and the shift to free market system in the 1990s in Russia have led to consequences such as acceleration in unemployment and economic segregation between low and high-income citizens. Privatization and real-estate establishment in modern Russia added development companies and banks into housing production game but still, citizens did not participate in the decision-making process on housing problems in the cities. Passive consumption of what was offered by the market and government programs have been observed till the present day in most of the Russian cities. Almost the same pattern is traced in Turkish housing policies TOKI is being criticized by specialists and people for the ignorance of citizens’ interests in favor of developers’ profit (Cakir, 2011; Turkun, 2015). Moreover, a high number of contradictory regulations and laws announced after the 2000s combined with a low number of houses with building and occupancy permits (around 33% only) complicate and prolong any interventions into the existing city fabric (TOKI, 2018).

3.CURRENT RENOVATION PROGRAMS APPLIED IN TURKEY AND RUSSIA.

As it has been told before, in Turkey the only authority providing RP is TOKI working under state legislation. In Russian Federation there is no general authority responsible for RP; each local government provides its own programs for the renewal of risky and dilapidated housing stock under the federal framework. What is worth attention is that both countries tend to apply on-site transformation in their RP because of the previous unsuccessful interventions as in case of Tarlabasi in Istanbul or local resettlement programs held in Russian cities, when people are being sent from central districts to newly-built districts far away from their usual place of living. Such interventions have led to social problems and loss of identity rather than improving citizens’ life (Turkun et al., 2014; Borushkina, 2018).

Table 3. Renovation Programs Held in Turkey and Russia in the Present Time

| | TOKI social housing and Renovation applications | A program of the Renovation of Moscow |
|---|--|---|
| Legislation | <p>Article 7 / e of the Law No. 5216 on the Metropolitan Municipality</p> <p>Article 73 of the Municipality Law No. 5393</p> <p>Article 4 and Annex 7 of the Law No. 2985 on Mass Housing</p> <p>“A shanty law No. 775”</p> <p>“Law No. 5366 on the Protection and Protection of Historical and Cultural Immovable Property”</p> <p>“Expropriation Law” No. 2942</p> <p>“The Law on the Regeneration of Areas under Disaster Risk, No. 6306” - defines the procedures and principles on rehabilitation, clearance and renewal of risky areas and risky buildings</p> | <p>Housing Code of Russian Federation – identification of terms</p> <p>Federal Law 185-FZ on the Housing and Utilities Reform Fund - determines the vector of housing development in Russia, and also contains the goals and objectives of the reforms, the main provisions on regional programs.</p> <p>Resolution of the Government of the Russian Federation of January 28, 2006 No. 47 - determines criteria for classifying houses as risky and to be demolished.</p> <p>“On the Housing Renovation Program in the City of Moscow” – detailed framework and standards.</p> |
| Actors | Government – Developers –Citizens - Specialists | Government – Citizens - Specialists |
| Citizens' participation form | Do not vote | Citizens (property owners only) were required to vote for/against renovation of their house (Governmental public services website, meetings of each house) |
| Scope | Differs according to the area being transformed (ex.: Basibuyuk - 1.6mln. m ² ; Tarlabasi - 0.02mln. m ² .) | Overall 5144 houses - 16 million sq. m |
| Aims | <p>1) to increase the quality of life in urban projects,</p> <p>2) to balance the increasing economic imbalances and global pressures</p> <p>3) to eliminate social inequality and housing problems</p> <p>4) to establish neighborhoods that prioritize values by solving many problems.</p> | <p>1) Better quality of life for the inhabitants of demolished obsolete houses</p> <p>2) Better urban environment</p> <p>3) Solving the problem of emergency and dilapidated housing</p> |
| Mechanism to enter and quit the program | <p>-The area of renovation is designated by municipalities.</p> <p>-If any recently built building located inside the renovation area, it may be resettled by the special commission decision in order to keep the integrity of the project.</p> | <p>-If a house was on the renovation list: > 1/3 of owners and tenants voted against the exclusion of their house from the program.</p> <p>- If a house was not on the renovation list: >2/3 of the total number of owners and tenants voted for the inclusion of their house in the program</p> |
| Territories/houses being renovated | Areas in the old parts of the city designated by the municipality to protect the historical and cultural fabric of the city or to take measures against the earthquake risk. (squatters, informal settlements, risky or dilapidated housing areas) | “Khrushchevkas” (1956-1967), as well as some other types of houses (including those of historical value), houses built in later periods. |
| Standards and opportunities | <p>-Equivalent housing for property owners (within new project). Housing for vulnerable social groups is being sold by price lower than market prices.</p> <p>-People living in informal houses without permission can be added to the program by taking a loan for a new house.</p> <p>-After distribution of the newly built houses to the property-right owners on the area, the tenants and limited right owners who resided</p> | <p>-Equivalent housing of current standards according federal set of rules and standards (the same living space and number of rooms, but bigger kitchen, bathrooms) within a micro district (or neighborhood in some cases).</p> <p>-An opportunity to pay the needed cost to improve their living conditions by buying a bigger apartment in new-built houses.</p> |

| | | |
|----------------|---|--|
| | in the area for more than one year can be offered to have a right for a house | -People have an opportunity to take a monetary compensation equivalent for their present apartment cost. |
| Outcome | <p>High-rise mass housing with improved infrastructure. Mostly monotonous architecture. Sometimes lack of greenery, and public spaces. Most of the ex-residents of the squatters who can not afford to join to the program have to move to other squatters.</p>  | <p>High-rise mass housing with improved infrastructure. Expected rise of height (by 2.18), better quality, heterogeneous architecture of the districts. All the residents are expecting to be resettled within the same district, extra housing will be sold.</p>  |

The mechanism set in a program of the Renovation of Moscow in 2017 was developed differently from previous applications by including the participation of citizens in the decision-making process, by adding more flexible mechanisms of implementation, totally governmental financing and as a result, higher quality of space was achieved (Potapenko, 2017; The official website of the Mayor of Moscow). In the beginning, the government of Moscow City was criticized for the choice of locations with higher profit. The program included some housing which has been totally overhauled by their residents before thus being in a good condition. In addition, people were concerned about the destruction of the historical fabric of the city and for including. However, after consultations with citizens and with the scientific council of the Department of Cultural Heritage of the city of Moscow and the public movement Arhnadzor, some districts, houses, historical heritage buildings were excluded from the program. Citizens could give their votes through Active Citizen app, My Documents Governmental center of state services (Gosuslugi), or at live meetings of owners, whose decisions took precedence over other means of expression of will. The program is being held in a more open way compared to previous interventions in order to prevent protests (the protest activity was slowed down significantly since the first announcement in May 2017) (Borushkina, 2018). In addition, mostly positive reactions of people who were settled in the initial phases (independent interviews and reaction in social media) show that this approach results in a higher level of trust.

While the Moscow renovation program draws on components from the obsolete housing RP adopted by Turkey, it also has its own traits that make the direct comparison impossible. The core idea of such programs is to redistribute poverty from depressed neighborhoods (squatters, informal settlements). The similar relocation was implemented during European and American neighborhood re-planning, mostly aiming to alter the spatial distribution of the disadvantaged residents (Miltenburg et

al., 2018). However, in Moscow, the inhabitants of renovated houses are a complex social mix; they belong to a variety of social groups of various education, professions, age, ethnicity, degrees of welfare etc. Therefore, the Moscow renovation program mostly aims to solve technical and infrastructural problems, not economic or social ones (Borushkina, 2018).

Thus, Turkey has more serious problems to be solved by the Housing Development Administration of Turkey (TOKI), responsible for urban regeneration and slum transformation projects in cooperation with municipalities around the country. It aims to increase the quality of life in urban projects, to balance the increasing economic imbalances and global pressures and to eliminate social inequality and housing problems (Isikkaya, 2016). However, the analysis of this approach shows that despite the fact that interventions aim to solve social issues as well as spatial and technical ones, habitants' participation is not considered as an important factor in making decisions. The situation is aggravated by the low level of education in the areas to be transformed, and complex property system (Turkun, 2014). Turkey has a comprehensive legislative base related to RP, but some of the laws have clauses, considered to be contradictory to each other by local specialists. In this scope, Russian lawyers also mention that "On the Housing Renovation Program in the City of Moscow" regulations are inconsistent with superior legislation clauses which cause difficulties during the appellations (Potapenko, 2017).

One of the most crucial disadvantages of RP both in Turkey and Russia is that tenants are being ignored, while in Moscow their proportion was up to 15% at the beginning of the program (inclined twice in 2017), and in Istanbul the proportion of tenants was around 46% (Cumhuriyet, 2.08.18; Vesti, 2.05.17). Some of the tenants of old 5-storey buildings in Moscow have already invested a lot of money for repairs. In Turkey, not only tenants' but also property owners' interests can be oppressed while even new-built and not risky houses may be demolished if they are considered violating the integrity of the project. Tenants and low-income people usually cannot afford loans to join the RP and have to relocate in other places according to their income.

When it comes to the outcome, the critiques for the TOKI's applications cannot be ignored. Designing high-density plots and using the same typology on every site are the main source of the problems in TOKI housing projects which are triggering the low profiled design and uniformity of Turkish cities. Regional features such as urbanity and urban morphology, topography, climate, cultural or regional differences are ignored by the organization (Isikkaya, 2016). For Russia, where the pattern of high-rise model has been used since the 1980s, the standards have been developed in such a way that people feel comfortable in 9-15-floor buildings provided with public services, which are being strictly regulated by urban planning standards of Russian Federation leaving enough space between buildings.

However, the projects offered for the Moscow Renovation program have to be more diverse and multi-level in order to avoid the monotonous design of ascetic pre-fabricated blocks. (Moscow Mayor Official Website, 2018).

4.CONCLUSIONS

The comparative analysis of housing policies history in Turkey and Russia related to social housing and Renovation Programs pursued in those countries displays some similarities and differences. Present problems related to housing originates from rapid urbanization period: illegal housing problem in Turkey, and aging after-war housing stock in Russia. Both countries' RP is being held under state management. However, the recent program of Renovation of Moscow looks more effective because of the collaborative approach for the decision-making process. The fact that Russia has rather technical and infrastructural problems, proves that the long-time application of heterogeneous high-rise model of social housing coupled with adequate urban planning and construction standards provides social inclusion within the city and prevent social segregation, which has been observed after the Pruitt-Igoe precedent in Saint-Louis, USA.

A framework for improvement of social housing policies can be determined after the comparative analysis of Turkey and Russia. 1) There should be a clear and open link between decision making actors (government, citizens, developers, specialists) during the RP development, application and further observation of the outcome. It may be provided by the governmental state of services (ex.: e-devlet, gosuslugi), special websites having all the information about RP with regular updates, and personal meetings with housing representatives and owners. This link will reduce the number of possible misunderstandings and protests. 2) The interests of long-term tenants (especially of vulnerable groups) should be taken into account by developing programs for their resettlement within the project. 3) The urban planning and construction standards should be reconsidered and set up for the whole country consistent with daily needs and human-oriented values, rather than market-oriented ones. 4) Legislation of the RP should match superior state legislation or if required changes into superior laws should be done in order to provide adequate support for RP interventions. 5) The state programs for illiterate citizens should be developed in order to help them understand their rights and obligations within the RP. 6) The legislation and framework of measures (algorithms) should be developed by the state in order to resettle citizens of informal settlements according to existing documents (help in the registration process), workplace, income, social status in order to prevent deprivation of their living conditions. 7) RP should include proper algorithms of actions for each type of property owners existing in a particular country. 8) The projects should provide diverse and multi-level design (reflecting local identity) with

adequate public services to provide social tolerance in a neighborhood attracting people with different income levels and from different social groups. 9) The rise in density should be regulated by superior strategic development plans of the city to avoid further mismatches and overload of city infrastructure.

REFERENCES

- Andrianova, G. (2015) "The Architecture of Soviet Housing and Main Soviet Urban Planning Concepts", Xi'an Jiaotong-Liverpool University. 10.13140/RG.2.1.5147.5366.
- ArchDaily. (2018, July 23) "100 Years of Mass Housing in Russia", Retrieved from <https://www.archdaily.com/898475/100-years-of-mass-housing-in-russia>.
- Arslan, H. (2014) "The Evolution of Housing Policy in the Urbanization Process in Turkey", International Refereed Journal of Social Sciences E-Journal.
- Borushkina, S. (2018) "Demolition vs. Renovation: A Case Study of Housing Modernization in Moscow Renovation Program", The International Building Exhibition (IBA), Vienna International Summer School 2018. Retrieved from https://iba-researchlab.at/wp-content/uploads/2018/09/Borushkina_renovation_Moscow.pdf
- Bronovitskaya, A. (2018, October 10) "The History of Mass Housing in Russia [Lecture]", Youtube, StrelkaKB. Retrieved from <https://youtu.be/dTjt5QcGypI>.
- Cakir, S. (2011) "Migration in Turkey", Urbanization/Squatters Problem and produced Policies. Journal of Social Sciences, May 2011, 23:209-222.
- Chamber of Civil Engineers Union of Chambers of Turkish Engineers and Architects (TMMOB). (2017) "What is Urban Regeneration?", Retrieved from http://www.imo.org.tr/resimler/ekutuphane/pdf/17132_24_25.pdf
- Cumhuriyet. (2018, August 2) "Which Neighborhood is the Most Tenant in Istanbul", Retrieved from http://www.cumhuriyet.com.tr/haber/ekonomi/1043813/istanbul_da_en_cok_kiraci_.html
- Hazar, E. (2015) "Re-Evaluation of the Concept of Social Housing in the Globalization Age: The Housing Practices in Turkey", Master Thesis, ITU Graduate School of Science, Engineering and Technology, Istanbul.
- Hazar, E., Cebi, P. (2016) "Analyzing Social Housing Practices in Turkey", 41st IAHS World Congress Sustainability and Innovation for the Future, Portugal.
- Hurriyet. (2018, August 24) "Syrian Refugees in Turkey to Exceed 5 Million in 2028", Retrieved from <http://www.hurriyetdailynews.com/syrian-refugees-in-turkey-to-exceed-5-million-in-2028>.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Isikkaya, A. D. (2016) "Housing Policies in Turkey: Evolution of TOKI (Governmental Mass Housing Administration) as an Urban Design Tool", *Journal of Civil Engineering and Architecture* 10 (2016) 316-326 doi: 10.17265/1934-7359/2016.03.006.
- Khan-Magomedov, S. (1966-1977) "Architecture of Residential Buildings of the USSR. 1917-1932", Leningrad; Moscow: Publishing House of Literature on Construction.
- The official website of the Mayor of Moscow. (2017) "The Moscow Renovation Standard", Retrieved from <https://www.mos.ru/city/projects/renovation>.
- Meuser P., Zadorin, D. (2015) "Towards a Typology of Soviet Mass Housing: Prefabrication in the USSR 1955 – 1991", Dom Publishers, Berlin.
- Miltenburg, E. M., Van de Werfhorst H. G., Musterd, S., Tieskens, K. (2018) "Consequences of Forced Residential Relocation: Early Impacts of Urban Renewal Strategies on Forced Relocates' Housing Opportunities and Socioeconomic Outcomes. *Housing Policy Debate*, 28 (4): 609–34. Taylor and Francis+NEJM.
- Tekeli İ. (2014) "Lessons to Turkey's Urbanization Experience", Retrieved from http://www.tepav.org.tr/upload/files/1456399342_2.Lessons_from_Turkey___s_Urbanization_Experience.pdf
- Trushin, G. (2017, May 2) "Rental Housing: Khrushchevki Go to Outsiders", *Vesti*. Retrieved from <https://realty.vesti.ru/zhile/arenda-zhilya-hrushevki-uhodyat-v-outsaydery>
- Turkun, A., (ed.) (2014) "Mulk, Mahal, İnsan - İstanbul'da Kentsel Donusum", İstanbul Bilgi Üniversitesi Yayınları.
- Turkun, A. (2011) "Urban Regeneration and Hegemonic Power Relationships. *International Planning Studies*", Routledge, 16(1): 61-72.
- Turkun, A. (2015) "New Urban Policies and Radical Transformations in Historic Urban Centers and Squatter Housing Neighbourhoods in Istanbul", Turkey. *Housing for the Urban Poor in Developing Countries*, Aldrich, B. C. and Sandhu, R. S. (eds.), Rawat Publications: India: 30-64.

**SİMETRİK VE ASİMETRİK KOŞULLU DEĞİŞEN VARYANS MODELLERİ İLE
VOLATİLİTE TAHMİNİ: BORSA İSTANBUL 100 ENDEKSİ UYGULAMASI**

Dr. Öğr. Üyesi Emre Esat TOPALOĞLU*

Öğr. Gör. Serdar YAMAN**

ÖZET

Bu çalışmada simetrik ve asimetrik koşullu değişen varyans modelleri ile Borsa İstanbul (BIST) 100 endeksinin 05.01.2000-13.09.2018 dönemine ait volatilitenin tahminlenmesini yapmak amaçlanmıştır. Bu doğrultuda endeks serisine ilişkin en uygun ARMA modeli belirlenerek serinin simetrik-asimetrik durumu analiz edilmiştir. Serinin simetrik durumu doğrusal ARCH ve GARCH modelleri ile incelenirken; asimetrik durumu ise EGARCH, APGARCH ve TGARCH modelleri ile incelenmiştir. Analiz sonucunda, BIST100 endeksinin volatilitenin yapısının APGARCH(1,1) modeli ile açıklandığı belirlenmiştir. Buna göre BIST100 endeksinde meydana gelen negatif bir şokun, endeksi aynı büyüklükteki pozitif şoktan daha fazla etkilediği diğer bir deyişle kaldıraç etkisinin geçerli olduğu, şokların getiri volatilitesi üzerinde asimetrik etkide bulunduğu, endekse gelen bir şokun etkisinin 86.29 gün sürdüğü ve şokların uzun hafıza özelliği gösterdiği ortaya çıkarılmıştır.

Anahtar Kelimeler: Koşullu Varyans Modelleri, Volatilitenin, Tahminleme, Borsa İstanbul.

JEL Kodları: C22, C53, G10.

**VOLATILITY FORECASTING WITH SYMMETRICAL AND ASYMMETRICAL
CONDITIONAL HETEROSCEDASTICITY MODELS: AN APPLICATION ON THE BORSA
İSTANBUL 100 INDEX**

ABSTRACT

The aim of this study is to forecast the volatility of the Borsa İstanbul 100 index until the period of 05.01.2000-13.09.2018 with symmetrical and asymmetrical conditional heteroscedasticity models. In this direction, the most appropriate ARMA model for the serie was identified and the symmetric-asymmetric states of the index was examined and analyzed the symmetric-asymmetric condition of the serie. While the symmetric state of index has been examined by linear ARCH and GARCH models; asymmetric condition is examined with EGARCH, APGARCH and TGARCH models. As a result of the

* Şırnak Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İşletme Bölümü, e-mail: emresatopal@hotmail.com

** Şırnak Üniversitesi, Cizre Meslek Yüksekokulu, Muhasebe ve Vergi Uygulamaları Bölümü, e-mail: sdr73@gmail.com

analysis, the volatility structure of the BIST100 index is analyzed by APGARCH (1,1) model. A negative shock from the financial side reveals that the index is more influenced by positive shock of the same magnitude, in other words, there is leverage effect, shock is asymmetric on return volatility, the effect of shock lasted 86.29 days and showed a long memory characteristic.

Keywords: *Conditional Heteroscedasticity Models, Volatility, Forecasting, Borsa Istanbul.*

JEL Codes: *C22, C53, G10.*

1.GİRİŞ

İşletmeler ve yatırımcılar sahip oldukları sermayeleri çeşitli iktisadi veya finansal faaliyetlerde kullanarak getiri elde etmeyi ve birikimlerini artırmayı hedeflerler. Gerek kurumsal gerekse bireysel yatırımcıların bu hedeflere ulaşmak için sahip oldukları fonları optimum şekilde değerlendirmeleri gerekmektedir. Fakat yatırım yapılan ekonomik veya finansal alanların sistematik risklere karşı duyarlılıkları ve içerdikleri sistematik olmayan riskler, fonların optimum şekilde değerlendirilmesine engel olabilmektedir. Bir yatırım aracının sistematik riske olan duyarlılığının yüksek olması ve sistematik olmayan riskinin yüksek olması, o yatırım aracından beklenen getirinin doğru tahmin edilmesini zorlaştırmaktadır. Yatırım araçlarının beklenen getirilerinin doğru tahmin edilmesi yatırımın amacına ulaşması açısından büyük önem taşımaktadır. Gelecekte sağlayacağı toplam getirisi bilinmeyen veya tahmin edilemeyen yatırım araçları riskli yatırım araçları olarak ifade edilebilir.

Finansal risk genel olarak, beklenen getirinin gerçekleşen getiriden sapma olasılığı olarak tanımlanabilir (Yıldız, 2016: 84). Finans teorisinde risk ve getiri kavramları önemli bir yere sahiptir. Modern Portföy Teorisi'ne göre, yatırımcılar yatırım kararı alırken rasyonel davranışlar sergileyerek belirli bir getiriye minimum risk seviyesinde ve belirli bir risk seviyesinde maksimum getiri elde etmek isterler. Diğer bir ifadeyle, yatırımcılar yatırım kararı alırken yatırımın taşıdığı risk ve yatırımdan beklenen getiriye göz önünde bulundurmaktadırlar. Yatırımcıların yatırım kararı alırken finansal yatırım araçlarının getirileri, riskleri ve birbirleriyle etkileşimlerini dikkate almalarından dolayı finansal piyasalarda, yatırım araçlarının taşıdığı risk ve beklenen getiri düzeylerinin tespiti büyük önem arz etmektedir.

Piyasalarda beklenmeyen olaylar yatırım araçlarının fiyatları üzerinde ani düşüş ya da yükselişlere, diğer bir ifadeyle yüksek oynaklığa (volatilité) sebep olmaktadır. Yatırım araçlarının fiyatlarında yüksek seviyede volatilitenin gözlenmesi o yatırım aracının riskinin yüksek olduğu anlamına gelmektedir. Dolayısıyla yatırımlarda dikkat edilen en önemli unsurlardan olan riskin ölçülmesi ve riskten korunma gereksinimlerinin belirlenmesi açısından değerlendirildiğinde volatilitenin yatırım kararlarındaki önemi daha iyi anlaşılmaktadır. Volatilité, negatif veya pozitif yönlü

sapmayı ifade etmek için kullanılan bir kavramdır. Bazı durumlarda olumlu sonuçlar vermesine karşın volatilité, risk açısından genel olarak negatif sonuçlar için kullanılan bir kavramdır (Chong, 2004; akt. Kuzu, 2018: 609). Yakın geçmişe kadar volatilité hesaplamalarında standart sapma ve varyans kullanılmıştır. Fiyat serilerine ilişkin varyansın zaman içerisinde değişmediği (homoskedasticity) varsayımına dayanan bu geleneksel yaklaşım, günümüz finansal piyasalarında finansal serilerin zamana bağlı olarak değişkenlik (heteroskedasticity) göstermelerinden dolayı doğru volatilité ölçümünde yetersiz kalmaktadır. Risk türlerindeki artış ve risklerin yapılarının daha karmaşık bir hal alması ile beraber volatilité hesaplamalarında ileri derece matematiksel ve istatistiki hesaplamalar gerektiren, kaldıraç etkisi (leverage effects), volatilité kümelenmesi (volatility clustering), asimetrik hareketler (gain/loss asymmetry) ve aşırı basıklık (leptokurtosis) gibi karakteristikleri dikkate alan ve zaman içerisinde değişen varyansı tahmin edebilen yeni ekonometrik yöntemler geliştirilmiştir. Bu ekonometrik yöntemlerden ilki 1982'de Engle tarafından ortaya konulan ARCH (Oto regresif Koşullu Değişen Varyans-Autoregressive Conditional Heteroskedasticity) modelidir. 1986'da Bollerslev çeşitli kısıtlamalara ve negatif varyanslı tahminleme gibi sakıncalara sahip olan ARCH modelini geliştirerek GARCH (Genelleştirilmiş Oto regresif Koşullu Değişen Varyans-Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity) modelini ortaya koymuştur. İlerleyen dönemlerde, GARCH modelinin pozitif ve negatif şoklar karşısında asimetrik tepkileri tam olarak yansıtamaması AGARCH, APGARCH, EGARCH, TGARCH, IGARCH gibi yeni modellerin ortaya çıkarılmasını sağlamıştır (Özden, 2008: 340; Şahin, Öncü ve Sakarya, 2015: 108).

Bu çalışmada, simetrik ve asimetrik koşullu değişen varyans modelleri kullanılarak Borsa İstanbul (BIST) 100 endeksinin 05.01.2000-13.09.2018 dönemini günlük logaritmik getirileri ele alınarak volatilité tahminlemesi yapılmaya çalışılmıştır. Çalışma genel olarak beş bölüme ayrılmıştır. Giriş'ten sonraki ikinci bölümde borsa endekslerinde volatilité tahminlemesini inceleyen yurt içi ve yurt dışı çalışmaların yer aldığı literatür araştırmasına yer verilmiştir. Çalışmanın üçüncü bölümünde, araştırmanın amacı, kapsamı ve takip edilen metodoloji anlatılmıştır. Dördüncü bölümde, araştırmanın bulgularına yer verilerek simetrik ve asimetrik koşullu değişen varyans modelleri için elde edilen analiz sonuçları yorumlanmıştır. Beşinci ve son bölümde ise, sonuç ve önerilere yer verilmiştir.

2. LİTERATÜR ARAŞTIRMASI

Çalışmanın bu bölümünde, çeşitli borsa endekslerinde volatilité modellemesi ve tahminlemesi üzerine yapılan yurt içi ve yurt dışı bazı çalışmalara yer verilmiştir.

Karmakar (2005), Hindistan pay senedi piyasasının volatilitésinin modellenmesine yönelik yaptığı çalışmada, GARCH(1,1) modelinin en iyi performansı sergileyen model olduğunu tespit

etmiştir. Çalışmanın sonucunda, zaman içinde endekste değişen dalgalanmalar olduğu yönünde kanıtlar elde edilmiştir.

Sarıoğlu (2006) çalışmasında, İMKB 100 Endeksi getiri volatilitésinin modellenmesi için GARCH modellerini kullanmıştır. Çalışma sonucunda, İMKB 100 Endeksi'nin volatilitésini tahminlemede en yüksek performansı sergileyen modellerin EGARCH ve GARCH modelleri olduğu tespit edilmiştir.

Akar (2007) çalışmasında, BİST 100 Endeksi'ne ilişkin 1990-2007 dönemi haftalık verilerini kullanarak BİST 100 endeksinin getiri volatilitésini modellemede kullanılabilecek en uygun koşullu değişen varyans modelini belirlemeye çalışmıştır. Çalışmada BİST 100 Endeksi'ne ilişkin getiri volatilitésinin modellenmesi için ARCH ve GARCH modelleri kullanılmıştır. Çalışma sonucunda, SWARC modelinin BİST 100 Endeksi'ne ilişkin getiri volatilitésini modellemede en uygun model olduğu belirlenmiştir.

Atakan (2009) yaptığı çalışmada, 1987-2008 dönemi İMKB 100 Bileşik Endeksi 1987-2008 dönemi günlük verileri kullanılarak İMKB'de volatilitenin modellenmesine ilişkin en uygun modelin belirlenmesi amacıyla ARCH ailesi modellerini kullanmıştır. Çalışmanın sonucunda, İMKB 100 Bileşik Endeksi volatilitésinin ARCH etkisi taşıdığı ve volatilité tahminlemede en iyi performansı GARCH(1,1) modelinin sergilediği tespit edilmiştir. Çalışmanın diğer bir sonucu da, kriz ve belirsizlik dönemlerinde İMKB 100 Bileşik Endeksi getirisinde volatilité kümelenmelerinin meydana geldiğidir.

Goudarzi ve Ramanarayanan (2010) yaptıkları çalışmada, BSE500 pay senedi endeksine ilişkin verileri kullanarak Hindistan pay senedi piyasasının volatilitésini ARCH modelleri ile incelemiştir. Çalışma sonucunda BSE500 pay senedi endeksinin volatilité modellenmesinde en uygun modelin GARCH(1,1) modeli olduğu tespit edilmiştir.

Çabuk, Özmen ve Kökcen (2011) yaptıkları çalışmada, BİST 100 Endeksi ve BİST Mali Endeksi'ne ilişkin 2004-2009 dönemi günlük verilerini kullanarak, endekslere ait volatilitenin modellenmesinde en iyi performansı gösteren modeli belirlemeye çalışmışlardır. Çalışmada volatilité modellenmesinde GARCH, ARCHM, M-GARCH, E-GARCH ve TARCH modelleri kullanılmıştır. Yapılan analizler sonucunda, BİST 100 ve BİST Mali Endeks'lerinin volatilitelerinin modellenmesinde en iyi performansı gösteren modelin E-GARCH modeli olduğu tespit edilmiştir.

Elsheikh ve Suliman (2011) yaptığı çalışmada, Sudan anapara borsasının volatilitésinin simetrik ve asimetric GARCH modelleri ile incelemiştir. Çalışmada, simetrik modellerden GARCH(1,1) ve GARCH-M(1,1) modelleri, asimetric modellerden ise, TARCH(1,1) ve PARARCH(1,1) modelleri

kullanılmıştır. Çalışmada sonucuna, simetrik modellerin asimetric modellere kıyasla volatilitte modellemesinde daha yüksek performans sergiledikleri tespit edilmiştir.

Gabriel (2012) yaptığı çalışmada, Bükreş Borsası'na ilişkin 09.03.2001-02.02.2012 dönemi günlük verileri kullanarak Romen Menkul Kıymetler Piyasası'nda volatilitte modellemesi için en uygun modeli belirlemeye çalışmıştır. Çalışmada GARCH tipi modeller kullanılmıştır. Çalışma sonucunda, Bükreş Borsası'nda volatilitte tahminlemesinde en iyi performansı sergileyen GARCH tipi modelin TGARCH modeli olduğu tespit edilmiştir.

Gürsoy ve Balaban (2014) çalışmalarında, 04.01.2007-31.12.2012 dönemine ait günlük İMKB Ulusal 100 Endeksi kapanış fiyatlarını kullanarak volatilitte tahminlemesi yapmışlardır. İMKB Ulusal 100 Endeksi'ne ilişkin volatilitte tahminlemesi yapılırken GARCH tipi modellerden GARCH(1,1), EGARCH(1,1) VE GJR-GARCH(1,1) modellerinin klasik çözümleri ve aynı modellerin Destek Vektör Makineleri yaklaşımı ile çözümleri kullanılmıştır. Çalışmanın sonucunda, Destek Vektör Makineleri yaklaşımı ile çözülen karma GARCH modellerinin klasik çözümlü GARCH modellerine kıyasla daha iyi performans gösterdiği tespit edilmiştir.

Karabacak, Meçik ve Genç (2014), BİST 100 Endeks getirisi ve altın getirisi volatilittesinin modellenmesi için en uygun koşullu değişen varyans modellerini belirlemeye amaçladıkları çalışmalarında, 03.01.2003-11.09.2013 dönemi günlük BİST 100 Endeksi getiri serisini ve 03.01.2005-10.09-2013 dönemi günlük altın borsası işlemlerini kullanmışlardır. Çalışma sonuçlarına göre, TARARCH(1,1) modelinin BİST 100 Endeksi volatilitte modellemesi için en uygun model olduğu ve meydana gelen şokların BİST 100 Endeks getiri serisinde asimetric etkilerinin olduğu belirlenmiştir. Altın getiri serisinin volatilitte modellemesi için en uygun model ise, GARCH(1,1) olarak belirlenmiştir.

Tuna ve İsaetli (2014) çalışmalarında, 2002-2012 dönemi BİST 100 Endeksi getiri serisindeki volatilitenin modellenmesi amacıyla ARCH ve GARCH modelleri kullanmışlardır. Çalışmanın sonuçlarına göre, BİST 100 Endeks getirisine ilişkin GARCH(1,1) modeli katsayısının yüksek değerlerde olduğu dolayısıyla volatilitenin süreklilik içerdiği tespit edilmiştir.

Şahin vd. (2015) çalışmalarında, 31.08.2007-31.12.2013 dönemi günlük verilerini kullanarak BİST Kurumsal Yönetim Endeksi'nin volatilitesini BİST 100 Endeksi'nin volatilitesi ile karşılaştırmak amacıyla ARCH, GARCH, EGARCH ve TGARCH modellerini kullanmışlardır. Çalışmanın sonuçlarına göre, her iki piyasada da volatilitte kümelenmesi gözlemlenmiş, BİST Kurumsal Yönetim Endeksi'nin volatilitesinin BİST 100 Endeksi'nin volatilitesine göre daha düşük olduğu tespit edilmiştir.

Koy ve Ekim (2016) çalışmalarında, BİST Banka, BİST Hizmetler, BİST Sınai ve BİST Ticaret endekslerine ilişkin 2011-2014 dönemi günlük kapanış fiyatlarını kullanarak volatilitte modellemesi

yapmışlardır. Endekslere ilişkin getiri serilerinin volatilité modellemesi ARCH ailesi modelleri olarak bilinen GARCH, EGARCH ve TARARCH modelleri ile gerçekleştirilmiştir. Çalışmanın sonuçlarına göre, BİST Hizmetler, BİST Sınai ve BİST Ticaret endeksleri için GARCH ve EGARCH modellerinin anlamlı sonuçlar verdiği, üç endekste de aynı büyüklükteki negatif şokların pozitif şoklara kıyasla volatilitéye daha fazla etki ettiği ve üç endekste de kaldıraç etkisinin olduğu tespit edilmiştir. BİST Banka endeksine ilişkin sonuçlara göre sadece GARCH modelinin anlamlı sonuç verdiği tespit edilmiştir.

Tamilselvan ve Vali (2016) yaptıkları çalışmada, Muscat Borsasında yer alan dört farklı endekse ait 2001-2015 dönemi verilerini kullanarak endekslerin volatilité modellemesini yapmışlardır. Çalışmada volatilité modellemesi için GARCH, EGARCH ve TGARCH modelleri kullanılmıştır. Çalışma sonucunda, GARCH modelinin her dört endekse ait en yüksek performans sergileyen volatilité modeli olduğunu tespit etmişlerdir.

Yıldız (2016) çalışmasında, BİST Hizmetler, BİST Mali ve BİST Sınai endekslerinin getiri serilerinin volatilitelerinin modellenmesi ve tahminlenmesinde hangi modellerin daha başarılı sonuçlar verdiği araştırılmıştır. Çalışmada endekslere ilişkin 05.01.2000-09.12.2015 dönemi günlük verileri kullanılmıştır. Çalışmanın sonuçlarına göre, BİST Mali ve BİST Sınai endekslerine ilişkin volatilité tahminlerinde en uygun model TGARCH (1,1), BİST Hizmetler endeksine ait volatilité tahmininde ise en uygun model CGARCH (1,1) olarak belirlenmiştir. Ayrıca, her üç endeks getiri serisi üzerinde de kaldıraç etkisinin var olduğu tespit edilmiştir.

Çalışkan Çavdar ve Aydın (2017) çalışmalarında, BİST Kurumsal Yönetim Endeksi'nin volatilitésini ARCH, GARCH ve SWARCH modelleri ile 03.03.2014-10.03.2017 günlük verilerini kullanarak incelemişlerdir. Çalışma sonucunda, SWARCH modelinin ARCH ve GARCH modellerine göre BİST Kurumsal Yönetim Endeksi'nin volatilitésini ölçmede daha iyi bir performans gösterdiği tespit edilmiştir.

Kılıç, Çelik ve Kaya (2017) çalışmalarında, BİST 100 Endeksi'ne ilişkin Şubat 2007-Şubat 2017 dönemi günlük verileri kullanarak, Student-t artıklarıyla klasik ve Bayesci GARCH (1,1) modellerinin, pay senedi getiri volatilitésini üzerindeki etkilerini karşılaştırmışlardır. Çalışmanın sonuçlarına göre, pay senedi getiri volatiliteleri için tahmin edilen klasik ve Bayesci GARCH(1,1) – Student-t model sonuçları arasında hem şokların volatilité üzerindeki etkisi hem de volatilité kalıcılığı açısından çok önemli bir farklılık bulunamamıştır.

Kula ve Baykut (2017) çalışmalarında, BİST Banka Endeksi'ne ilişkin 02.01.1997-31.12.2016 dönemi günlük verileri kullanarak endeksin volatilité yapısını MSGARCH modeli ile analiz etmişlerdir.

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Çalışmanın sonuçlarına göre, BİST Banka Endeksi'nde düşük riskli rejim ısrarcılığının hakim olduğu, endeksin düşük rejimde olmaya yönelik yüksek olasılığa sahip olduğu, yüksek riskli rejimde iken de kararlılık sergilemeyip düşük riskli rejime geçme eğilimine sahip olduğu tespit edilmiştir. Çalışma da ayrıca, BİST Banka Endeksi'nde düşük riskli rejime kıyasla yüksek riskli rejimin piyasa şoklarına karşı volatilité artışı şeklinde tepkisinin daha fazla olduğu ve her iki rejimde de volatilité ısrarcılığının yüksek seviyelerde olduğu tespit edilmiştir.

Şencan (2017) çalışmasında BİST Altın Endeksi getiri volatilitésinin modellenmesi için en uygun koşullu değişen varyans modelinin belirlenmesi amacıyla 01.08.2012-13.10.2015 dönemi günlük verilerini kullanmıştır. Simetrik ve asimetrik GARCH tipi modellerin kullanıldığı çalışmanın sonucunda, GARCH(1,1) modeli BİST Altın Endeksi getirilerine ilişkin volatilité modellemesinde en iyi model olarak belirlenmiştir.

Kuzu (2018) yaptığı çalışmada, BIST 100 Endeksi'ne ilişkin 2011-2017/3 dönemi günlük kapanış verilerini kullanarak BIST 100 Endeksi getiri volatilitésini ARCH, GARCH, EGARCH ve TGARCH modelleri ile incelemiştir. Çalışmada kullanılan modellere ilişkin sonuçlar karşılaştırılarak açıklayıcılık derecesi en yüksek modelin hangisi olduğu ortaya konmaya çalışılmıştır. Çalışma sonucunda, BIST 100 Endeksi getiri volatilitésinin modellenmesinde en yüksek performansı sergileyen modelin TGARCH modeli olduğu tespit edilmiştir.

3. VERİ VE METODOLOJİ

Bu çalışmada Borsa İstanbul (BIST) 100 endeksinin volatilité tahminlemesi, simetrik ve asimetrik koşullu varyans modelleri ile yapılmaya çalışılmıştır. Endekse ilişkin 05.01.2000-13.09.2018 dönemine ait günlük verilerin kullanıldığı çalışmada, endekslerine ait veriler investing.com veri tabanından sağlanmıştır. Endekslere ilişkin kapanış değerleri kullanılarak sürekli getiriler aşağıdaki formül doğrultusunda hesaplanmıştır.

$$R_t = \ln\left(\frac{P_t}{P_{t-1}}\right) \quad (1)$$

Borsa endekslerinin volatilité yapılarının tahminlemesinde;

Serilerin birim kök içerip içermediği araştırılmakta,

Volatilité tahmini için en uygun başlangıç modeli, Schwarz bilgi kriteri esas alınarak uygun gecikme uzunluğuna göre tespit edilmekte,

Serilerin normal dağılıma uyup uymadıkları belirlenmekte,

Hata terimine ilişkin değişen varyans ve otokorelasyon sorunlarının olup olmadığı,

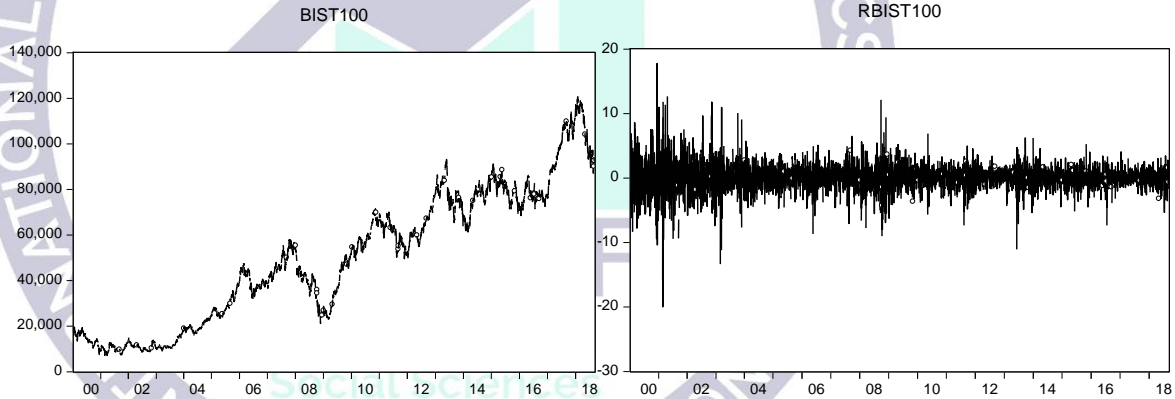
Serinin doğrusal olmayan unsurlar içerip içermediği incelenmektedir.

Zaman serisi için en uygun ARMA modelinin belirlendikten sonra simetrik ve asimetrik volatilité modelleri sınanmış ve katsayılar hesaplanmıştır. Sonrasında ise volatilité modellerinde elde edilen katsayı ve koşullar doğrultusunda model karşılaştırması yapılarak en uygun volatilité modeli tespit edilmiştir.

4.AMPRİK BULGULAR

İncelenen dönem itibariyle BIST100 endeksine ilişkin volatilité tahminini gerçekleştirebilmek üzere yukarıda tanımlanan varsayımlardan ilki olan serinin durağanlık durumları analiz edilmiş ve tanımlayıcı istatistik sonuçları değerlendirilmiştir. Endekse ait zaman serisinin fiyat ve getiri grafikleri Şekil 1’de sunulmaktadır.

Şekil 1. BİST-100 Endeksine İlişkin Fiyat ve Getiri Grafikleri



Şekil 1 incelendiğinde, endeks fiyat serisinin yükselen bir trend içerisinde olduğunu ve durağan bir yapıda olmadığını söylemek mümkündür. Endeksin getiri grafiğine göre ise seride durağanlığın sağlandığı ve 2001, 2008 ve 2013 yıllarında volatilité kümelenmelerinin gerçekleştiği görülmektedir. Bu kümelenmelerin, 2001 ve 2008 yıllarında ortaya çıkan yerel ve küresel finansal krizler ve 2013’te yaşanan gezi olayları sonucunda meydana geldiğini ifade etmek mümkündür. Volatilité tahmini için kullanılan endeks getiri serisinin ortalama değerlere sahip olduğu ve serinin durağan bir yapıya sahip olduğu gözlemlenebilmektedir. Bu gözlem, birim kök testlerinde elde edilecek bulgular ile desteklenebilmektedir. Bu bağlamda, BIST100 serisine ilişkin birim kök test sonuçları Tablo 1’de gösterilmektedir.

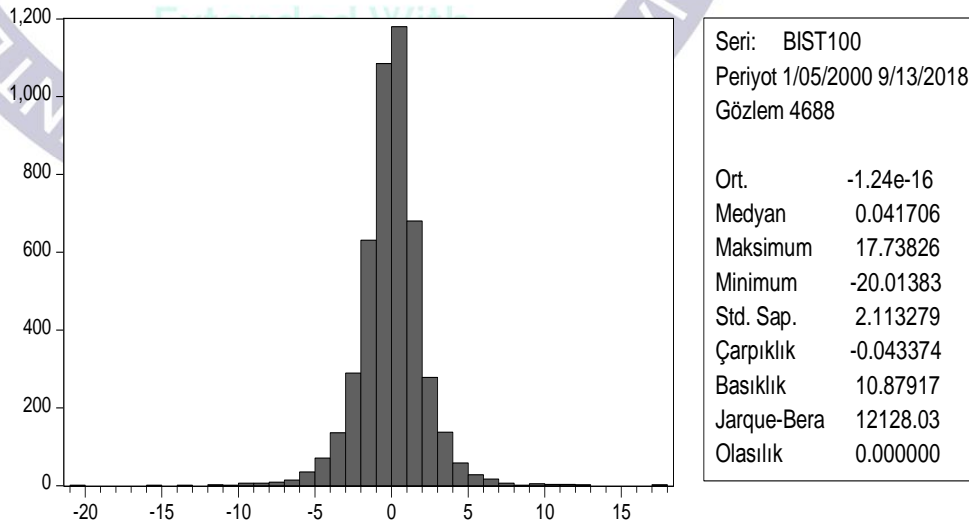
Tablo 1. Birim Kök Test Sonuçları

| BIST 100 | | | | | | | |
|-----------------------|------|-------|-------|--------------|---------------|-----------------|-------|
| | Test | Fark | Yüzde | Kritik Değer | t-istatistiği | Olasılık Değeri | Karar |
| Sabit | ADF | Düzye | % 1 | -3.431 | -68.202 | 0.0001 | I(0) |
| | | | % 5 | -2.861 | | | |
| | | | % 10 | -2.567 | | | |
| | PP | Düzye | % 1 | -3.431 | -68.203 | 0.0001 | I(0) |
| | | | % 5 | -2.861 | | | |
| | | | % 10 | -2.567 | | | |
| Trend ve Sabit | ADF | Düzye | % 1 | -3.959 | -68.195 | 0.0000 | I(0) |
| | | | % 5 | -3.410 | | | |
| | | | % 10 | -3.127 | | | |
| | PP | Düzye | % 1 | -3.959 | -68.196 | 0.0000 | I(0) |
| | | | % 5 | -3.410 | | | |
| | | | % 10 | -3.127 | | | |

H₀=Birim Kök Vardır. H₁=Birim Kök Yoktur.

ADF ve PP birim kök test sonuçları değerlendirildiğinde, BIST100 endeksi için hesaplanan olasılık değerlerinin kritik değer olarak kabul edilen 0.05'ten küçük olduğu tespit edilmiş ve sıfır hipotezi reddedilmiştir. Dolayısıyla serinin her iki yöneme göre de düzeyde durağan oldukları I(0) ortaya çıkarılmıştır. Bu bağlamda ARMA modelinin belirlenebilmesi için durağanlık koşulu sağlanmış ve sonrasında normal dağılım varsayımı test edilmiştir. Normal dağılım ve tanımlayıcı istatistik sonuçlar, Şekil 2'de yer almaktadır.

Şekil 2. Tanımlayıcı İstatistikler



Tanımlayıcı istatistik sonuçlarına göre, BIST100 endeksine ait getiri ortalamasının negatif olduğu hesaplanmıştır. Endekste maksimum getiri %17.73, minimum getiri ise -%20.01 olarak belirlenirken;

çarpıklık katsayı -0.043, basıklık katsayısı ise 10.879 olarak belirlenmiştir. Finansal serilerde, çarpıklık katsayısı genel olarak negatif ve daha dik olmakta birlikte basıklık katsayısı ise 3'e yakın olmalıdır. Jargue-Bera olasılık değeri ise kritik değerin altındadır ve serinin normal dağıldığını ifade eden sıfır hipotezi reddedilmiştir. Basıklık, çarpıklık katsayıları ve Jargue-Bera olasılık değeri dikkate alındığında serinin normal dağılıma sahip olmadığı tespit edilmiştir. Finansal verilerin genel olarak normal dağılım varsayımına uygun hareket etmedikleri doğrultusunda seriye ilişkin ARMA modeli Schwarz Bayesyan Bilgi Kriteri (SBIC) esas alınarak belirlenmiştir. Bu bağlamda AR (p) ve MA (q) değerleri için 5. gecikmeye kadar olan kombinasyonlar oluşturulmuştur. Bilgi kriteri sonuçları Tablo 2'te sunulmaktadır.

Tablo 2. Schwarz Bilgi Kriterine Göre ARMA(p/q) Seçimi

| BIST100 | | | | | | |
|---------|-----------------|----------|----------|----------|----------|----------|
| p/q | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 0 | 4.335948 | 4.339540 | 4.341209 | 4.342948 | 4.344689 | 4.346301 |
| 1 | 4.339539 | 4.340609 | 4.342987 | 4.344400 | 4.346067 | 4.347408 |
| 2 | 4.341213 | 4.342991 | 4.342647 | 3.342958 | 4.344756 | 4.343999 |
| 3 | 4.342951 | 4.344352 | 4.343250 | 4.341463 | 4.346749 | 4.345318 |
| 4 | 4.344667 | 4.345959 | 4.344800 | 4.346765 | 4.347469 | 4.346508 |
| 5 | 4.346239 | 4.347307 | 4.343998 | 4.345203 | 4.346493 | 4.349155 |

SBIC değerleri incelendiğinde, BIST100 endeksi için ARMA(0,0) modelinin 4.335948 katsayısına sahip olduğu ve bu katsayıların diğer modellerde sağlanan katsayılarından daha düşük olduğu belirlenmiştir. Dolayısıyla endeks için de en uygun model olarak ARMA(0,0) seçilmiştir. ARMA modelinin seçimi sonrasında volatilité tahmini için seride değişen varyans ve otokorelasyon varsayım sınamalarının yanı sıra seride doğrusal olmayan unsurların varlığının araştırılması gerekmektedir. Seride değişen varyans, otokorelasyon ve doğrusal olmayan unsurların varlığı söz konusu olduğunda volatilité tahminlemesi yapabilmek için ARCH/GARCH türevi modellere ihtiyaç duyulmaktadır. Bu doğrultuda BIST100 serisine ilişkin hata teriminin varyansının sabit olup olmadığı diğer bir deyişle değişen varyans durumu araştırılmıştır. Bu amaçla 1, 5, 10, 20 ve 30. gecikme değerleri için ARCH-LM testi uygulanmıştır. Analiz sonuçları Tablo 3'te gösterilmektedir.

Tablo 3. ARCH LM Değişen Varyans Test Sonuçları

| BIST100 | | | | |
|------------|---------------|--------------------------|-------------------------|---------------------------|
| ARMA (0,0) | F İstatistiği | F İstatistiği Anlamlılık | Gözlenen R ² | R ² Anlamlılık |
| 1.Gecikme | 488.040 | 0.0000 | 442.186 | 0.0000 |
| 5.Gecikme | 191.750 | 0.0000 | 796.671 | 0.0000 |
| 10.Gecikme | 98.031 | 0.0000 | 812.049 | 0.0000 |
| 20.Gecikme | 52.311 | 0.0000 | 857.822 | 0.0000 |
| 30.Gecikme | 35.730 | 0.0000 | 876.132 | 0.0000 |

ARCH-LM test sonuçlarına göre tüm gecikme değerleri için hesaplanan olasılık değerlerinin kritik değerin altında olduğu belirlenmiş ve seriyeye ait hata teriminin varyansının sabit olduğunu ifade eden sıfır hipotezi reddedilmiştir. Dolayısıyla seride değişen varyans sorununa rastlanılmıştır. Volatilite tahmininin gerçekleştirilebilmesi için bir diğer koşul olan otokorelasyon varsayımı ise Hata Terimleri Korelogramları esas alınarak incelenmiştir. Analiz sonuçları Tablo 4'te yer almaktadır.

Tablo 4. Hata Terimleri Korelogramları

| BIST100 | | | | | |
|-------------------|-----------|-----------|------------|------------|------------|
| ARMA (0,0) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| AC | 0.307 | 0.170 | 0.111 | 0.104 | 0.079 |
| PAC | 0.307 | 0.084 | 0.049 | 0.025 | 0.020 |
| Q-İstatistik | 442.53 | 1417.2 | 1706.0 | 2142.5 | 2453.1 |
| Olasılık | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |

Tablo 4'te yer alan analiz sonuçları değerlendirildiğinde, Q istatistiği olasılık değerlerinin tüm gecikmeli değerler için kritik değerin altında olduğu ve seride otokorelasyon sorununun da bulunduğu tespit edilmiştir. BIST100 endeksi serisinde varlığı belirlenen değişen varyans ve otokorelasyon sonrasında seride doğrusal olmayan unsurların yer alıp almadığının incelenmesi gerekmektedir. ARMA modeli sadece serideki doğrusal unsurları dikkate almaktadır. Eğer incelenen seri doğrusal olmayan unsurlar içeriyorsa, volatilite yapısının ortaya çıkarılabilmesi için ARCH/GARCH türev modellerinin kullanılması gerekmektedir. Seride doğrusal unsurların olup olmadığı Brock, Dechert ve Schienkman (1987) BDS Doğrusallık testi ile sınanmıştır. BDS test sonuçları Tablo 5'te gösterilmektedir.

Tablo 5. BDS Doğrusallık Test Sonuçları

| | Boyut | BDS İstatistik | Std. Hata | z-istatistik | Olasılık Değeri |
|----------------|--------------|-----------------------|------------------|---------------------|------------------------|
| BIST100 | 2 | 0.021 | 0.001 | 16.060 | 0.0000 |
| | 3 | 0.047 | 0.002 | 22.323 | 0.0000 |
| | 4 | 0.066 | 0.002 | 26.359 | 0.0000 |
| | 5 | 0.078 | 0.002 | 29.950 | 0.0000 |
| | 6 | 0.083 | 0.002 | 33.210 | 0.0000 |

BDS test sonuçlarına göre, endeks için de BDS testi olasılık değerlerinin 0.05 kritik değerinin altında olduğu belirlenmiş ve serilerin doğrusal unsurlar içermediğini ifade eden sıfır hipotezi reddedilmiştir. Dolayısıyla, serinin doğrusal olmayan unsurlar içerdiği belirlenmiş ve ARMA modelinin yerine ARCH/GARCH modellerine ihtiyaç duyulduğu ortaya çıkarılmıştır.

BIST100 serisi volatilite tahminlemesi için ARCH (p) ve GARCH (p,q) simetrik modelleri ve EGARCH (p,q), APGARCH (p,q) ve TGARCH (p,q) asimetrik modelleri kullanılmıştır. Çalışmada p

ve q değerleri, anlamlılık ve parametre kısıt koşulları doğrultusunda belirlenmiştir. Volatilite tahmin modellerine ilişkin analiz sonuçları Tablo 6'da gösterilmektedir.

Tablo 6. ARMA(0,0) Volatilite Tahmin Modelleri Sonuçları

| Seri | Modeller | Katsayılar | | | | | | | |
|---------|--------------------|---|------------|------------|------------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | α_0 | α_1 | α_2 | α_3 | β_1 | β_2 | β_3 | γ_1 |
| BIST100 | ARCH (p=1) | 3.147 | 0.294 | - | - | - | - | - | - |
| | ARCH (p=2) | 2.203 | 0.237 | 0.281 | - | - | - | - | - |
| | ARCH (p=3) | 1.627 | 0.168 | 0.249 | 0.260 | - | - | - | - |
| | | $h_t = \alpha_0 + \sum_{i=1}^q \alpha_i u_{t-i}^2$ | | | | | | | |
| BIST100 | GARCH (p=1, q=1) | 0.047 | 0.085 | - | - | 0.904 | - | - | - |
| | | $h_t = \alpha_0 + \sum_{i=1}^q \alpha_i u_{t-i}^2 + \sum_{i=1}^p \beta_i h_{t-i}$ | | | | | | | |
| BIST100 | TGARCH (p=1, q=1) | 0.054 | 0.055 | - | - | 0.901 | - | - | 0.062 |
| | | $h_t = \alpha_0 + \sum_{i=1}^q \alpha_i u_{t-i}^2 + \gamma_i u_{t-i}^2 d_{t-1} + \sum_{i=1}^p \beta_i h_{t-i}$ | | | | | | | |
| BIST100 | EGARCH (p=1, q=1) | -0.116 | 0.179 | - | - | 0.982 | - | - | -0.047 |
| | | $\log(h_t) = \alpha_0 + \sum_{j=1}^q \beta_j \log(h_{t-j}) + \sum_{i=1}^p \alpha_i \frac{ u_{t-i} }{\sqrt{h_{t-i}}} + \sum_{k=1}^r \gamma_k \frac{u_{t-k}}{\sqrt{h_{t-k}}}$ | | | | | | | |
| BIST100 | APGARCH (p=1, q=1) | 0.046 | 0.088 | - | - | 0.904 | - | - | 0.208 |
| | | $\sigma_t^d = \alpha_0 + \sum_{i=1}^q \alpha_i (\varepsilon_{t-i} + \gamma_i \varepsilon_{t-i})^d + \sum_{i=1}^p \beta_i \sigma_{t-i}^d$ | | | | | | | |

En uygun modelin seçilmesi için çeşitli derecelerde ARCH, GARCH, TARCH, EGARCH, PGARCH gibi birçok model denenmiştir. Tablo 6'daki modeller, denenilen modellerin yalnızca bir kısmıdır. Denenilen modellere ait sonuçlar, anlamlılık ve parametre kısıt koşulları göz önünde bulundurularak süzgeçten geçirilmiş ve kayda değer bulunan modeller tablolarda özetlenmiştir.

BIST100 endeksi için simetrik ve asimetrik modeller ile volatilite tahminlemesi gerçekleştirilmiştir. Modellerle ilişkin katsayılar hesaplanmış ve bu katsayıların ARCH, GARCH, TGARCH, EGARCH ve PGARCH modellerine ait kısıtları aşip aşamadıkları incelenmiş ve endekslere ilişkin bulgular elde edilmiştir. Tablo 6'da incelenen modeller haricindeki diğer modeller, negatif katsayı taşımama ya da olasılık değerlerinin anlamsız olmama kısıtlarından dolayı analiz kapsamına dâhil edilememiştir. BIST100 endeksi için volatilite tahminlemesinde kullanılacak olan modellerde değişen varyans sorununun giderilip giderilemediğini tespit edebilmek için tekrar ARCH-LM testi uygulanmıştır. İlgili modellerde değişen varyans sorunu giderilememişse endekslere ilişkin volatilite

tahmininde ARCH/GARCH türevi modellerinin yetersiz kaldığı tespit edilmektedir. ARCH-LM test sonuçları, Tablo 7'de gösterilmektedir.

Tablo 7. ARCH LM Değişen Varyans Test Sonuçları

| Seri | ARCH (1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
|------------------------------|-------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| BIST100 ARMA(0,0) | F İstatistiği | 0.7453 | 49.7034 | 34.0526 | 18.3265 | 13.1255 |
| | F İstatistiği | 0.3880 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 |
| | Olasılık | | | | | |
| | Gözlenen R ² | 0.7455 | 236.2810 | 318.1174 | 341.269 | 365.3166 |
| | R ² Olasılık | 0.3879 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 |
| | ARCH (2) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| | F İstatistiği | 0.9740 | 12.7122 | 21.2876 | 13.2025 | 9.4460 |
| | F İstatistiği | 0.3237 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 |
| | Olasılık | | | | | |
| | Gözlenen R ² | 0.9742 | 62.7896 | 204.0701 | 250.9824 | 268.8154 |
| | R ² Olasılık | 0.3236 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 |
| | ARCH (3) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| | F İstatistiği | 0.0025 | 4.5586 | 22.3890 | 13.9258 | 9.7682 |
| | F İstatistiği | 0.9598 | 0.0004 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 |
| | Olasılık | | | | | |
| | Gözlenen R ² | 0.0002 | 22.7116 | 214.1454 | 263.9547 | 277.4407 |
| | R ² Olasılık | 0.9598 | 0.0004 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 |
| | GARCH (1,1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| | F İstatistiği | 1.9360 | 1.4695 | 1.3083 | 1.0919 | 0.9849 |
| | F İstatistiği | 0.1642 | 0.1963 | 0.2194 | 0.3498 | 0.4893 |
| | Olasılık | | | | | |
| | Gözlenen R ² | 1.9360 | 7.3457 | 13.0779 | 21.8359 | 29.5565 |
| | R ² Olasılık | 0.1641 | 0.1962 | 0.2193 | 0.3495 | 0.4885 |
| | TGARCH (1,1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| F İstatistiği | 0.1544 | 0.9874 | 1.0364 | 0.9667 | 0.8442 | |
| F İstatistiği | 0.6943 | 0.4237 | 0.4093 | 0.5004 | 0.7087 | |
| Olasılık | | | | | | |
| Gözlenen R ² | 0.1545 | 4.9385 | 10.3658 | 19.3411 | 25.3574 | |
| R ² Olasılık | 0.6943 | 0.4234 | 0.4090 | 0.4998 | 0.7075 | |
| EGARCH (1,1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme | |
| F İstatistiği | 1.5867 | 2.4793 | 2.3550 | 1.5523 | 1.2340 | |
| F İstatistiği | 0.2079 | 0.0299 | 0.0090 | 0.0552 | 0.1776 | |
| Olasılık | | | | | | |
| Gözlenen R ² | 1.5868 | 12.3796 | 23.4877 | 30.9797 | 36.9734 | |
| R ² Olasılık | 0.2078 | 0.0299 | 0.0091 | 0.0555 | 0.1779 | |
| APGARCH (1,1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme | |
| F İstatistiği | 0.3468 | 1.2690 | 1.2941 | 1.0811 | 0.9222 | |
| F İstatistiği | 0.5559 | 0.2743 | 0.2273 | 0.3618 | 0.5880 | |
| Olasılık | | | | | | |
| Gözlenen R ² | 0.3469 | 6.3448 | 12.9363 | 21.6193 | 27.6865 | |
| R ² Olasılık | 0.5558 | 0.2741 | 0.2273 | 0.3615 | 0.5870 | |

Tablo 7'de yer alan ARCH-LM değişen varyans test sonuçları incelendiğinde, GARCH (1,1), TGARCH (1,1) ve APGARCH (1,1) modelleri haricindeki diğer modeller için değişen varyans sorunu

giderilememiştir. Dolayısıyla, ARCH (1), ARCH (2), ARCH (3) ve EGARCH (1,1) modelleri analiz kapsamından çıkarılmıştır. Değişen varyans sorununun giderilmesinin ardından serilerde otokorelasyon sorununun da olmaması da beklenen bir sonuçtur. Bu bağlamda hata terimleri korelogramları hesaplanarak otokorelasyon durumları tekrar sınanmıştır. Analiz sonuçları Tablo 8'de gösterilmektedir.

Tablo 8. Hata Terimleri Korelogramları

| SERİ | ARCH (1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
|------------------------------|---------------------|-----------|------------|------------|------------|------------|
| BIST100 ARMA(0,0) | AC | -0.013 | 0.123 | 0.114 | 0.066 | 0.077 |
| | PAC | -0.013 | 0.098 | 0.080 | 0.030 | 0.034 |
| | Q-İstatistik | 0.7461 | 271.78 | 466.59 | 630.61 | 786.85 |
| | Olasılık | 0.388 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| | ARCH (2) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| | AC | -0.014 | 0.074 | 0.162 | 0.053 | 0.043 |
| | PAC | -0.014 | 0.079 | 0.156 | 0.012 | 0.014 |
| | Q-İstatistik | 0.9751 | 59.289 | 218.09 | 329.52 | 410.69 |
| | Olasılık | 0.323 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| | ARCH (3) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| | AC | -0.001 | 0.045 | 0.194 | 0.034 | 0.031 |
| | PAC | -0.001 | 0.044 | 0.196 | -0.012 | 0.022 |
| | Q-İstatistik | 0.0025 | 23.679 | 213.28 | 266.48 | 308.22 |
| | Olasılık | 0.960 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| | GARCH (1,1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| | AC | 0.020 | -0.000 | 0.017 | -0.010 | 0.000 |
| | PAC | 0.020 | -0.001 | 0.018 | -0.010 | -0.001 |
| | Q-İstatistik | 1.9377 | 7.5954 | 13.515 | 22.414 | 30.547 |
| | Olasılık | 0.164 | 0.180 | 0.196 | 0.318 | 0.438 |
| | TGARCH (1,1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| | AC | 0.006 | 0.000 | 0.016 | -0.008 | 0.002 |
| | PAC | 0.006 | -0.001 | 0.017 | -0.008 | 0.001 |
| | Q-İstatistik | 0.1546 | 4.9547 | 10.632 | 19.239 | 25.353 |
| | Olasılık | 0.694 | 0.421 | 0.387 | 0.506 | 0.708 |
| | EGARCH (1,1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme |
| | AC | 0.018 | 0.002 | 0.040 | -0.004 | 0.001 |
| | PAC | 0.018 | 0.000 | 0.041 | -0.004 | 0.001 |
| | Q-İstatistik | 1.5881 | 12.773 | 23.872 | 31.025 | 37.689 |
| Olasılık | 0.208 | 0.026 | 0.008 | 0.055 | 0.158 | |
| APGARCH (1,1) | 1.Gecikme | 5.Gecikme | 10.Gecikme | 20.Gecikme | 30.Gecikme | |
| AC | 0.009 | 0.001 | 0.023 | -0.007 | 0.002 | |
| PAC | 0.009 | -0.000 | 0.024 | -0.007 | 0.001 | |
| Q-İstatistik | 0.3473 | 6.4041 | 13.202 | 21.522 | 27.863 | |
| Olasılık | 0.556 | 0.269 | 0.213 | 0.367 | 0.578 | |

Tablo 8'deki Q istatistik ve anlamlılık düzeyleri değerlendirildiğinde, GARCH (1,1), TGARCH (1,1) ve APGARCH (1,1) modelleri dışında kalan diğer modellerde otokorelasyon sorununun

çözülemediği belirlenmiştir. Dolayısıyla, ARCH (1), ARCH (2), ARCH (3) ve EGARCH (1,1) modelleri analize dâhil edilememiştir. BIST100 serisine ilişkin elde edilen otokorelasyon sonuçları değişen varyans sonuçlarını destekler niteliktedir. Hata terimine ilişkin gerçekleştirilen değişen varyans ve otokorelasyon test sonuçları doğrultusunda endeksin volatilité tahminlemede kullanılmak üzere tespit edilen modellerden en uygun olanını seçebilmek için model karşılaştırması yapılmıştır. Model karşılaştırması için Theil Eşitsizlik Katsayısı (TIC), Kök Ortalama Kare Hata (RMSE) ve Ortalama Mutlak Hata (MAE) katsayıları hesaplanmıştır. Çalışmada, endekste model karşılaştırması için RMSE katsayıları esas alınmıştır. Bu katsayılara ilişkin elde edilen sonuçlar Tablo 9'da yer almaktadır.

Tablo 9. Volatilité Modeli Karşılaştırmaları

| Seri | Modeller | Theil Eşitsizlik Katsayısı | Kök Ortalama Kare Hata (RMSE) | Ortalama Mutlak Hata (MAE) |
|---------|----------------|----------------------------|-------------------------------|----------------------------|
| BIST100 | GARCH (1, 1) | 0.958090 | 2.113839 | 1.461093 |
| | TGARCH (1, 1) | 0.969229 | 2.113291 | 1.461081 |
| | APGARCH (1, 1) | 0.969249 | 2.113290 | 1.461081 |

RMSE katsayıları incelendiğinde, en düşük RMSE değeri 2.113290 olarak hesaplanmış ve volatilité tahminlemede BIST100 endeksi için en uygun modelin APGARCH (1,1) olduğu ortaya çıkarılmıştır. Tablo 10'da BIST100 endeksi için 05.01.2000-13.09.2018 dönemine ait volatilité tahminleme sonuçları sunulmaktadır.

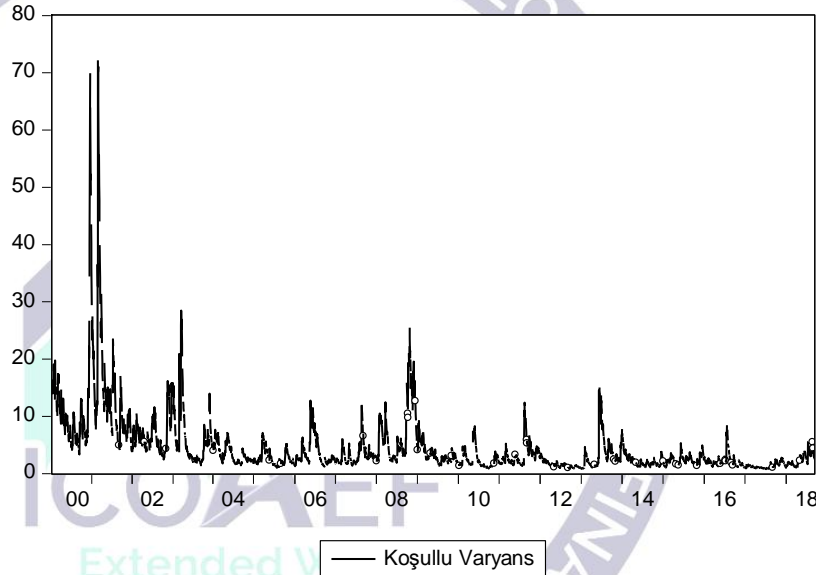
Tablo 10. Volatilité Tahmin Sonuçları

| Seri | Model | Katsayılar | | | | | | | |
|---------|--------------------|------------|------------|------------|------------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | α_0 | α_1 | α_2 | α_3 | β_1 | β_2 | β_3 | γ_1 |
| BIST100 | APGARCH (p=1, q=1) | 0.046 | 0.088 | - | - | 0.904 | - | - | 0.208 |

APGARCH modelinin geçerli olabilmesi için α_i , β_i ve γ_1 katsayılarının anlamlı ve sıfırdan büyük olması, ARCH ve GARCH katsayıları toplamının da 1'den küçük olması gerekmektedir. APGARCH (1,1) modelinde hesaplanan katsayılar ve anlamlılık düzeyleri bu koşulları sağlamaktadır. APGARCH (1,1) asimetrik modelde kaldıraç parametresi (γ_1), pozitif ve anlamlı bulunmuştur. Bu durum, koşullu varyansta negatif getiriler için kaldıraç etkisinin varlığını göstermektedir. Dolayısıyla, geçmiş dönemde yaşanan negatif şoklar diğer bir deyişle olumsuz haberler, serinin bugünkü koşullu varyansı üzerinde aynı büyüklükteki pozitif şoklara yan olumlu haberlere kıyasla daha derin bir etkiye yol açmaktadır. Diğer bir ifadeyle, BIST100 endeksinde meydana gelen negatif bir şokun, endeksi aynı büyüklükteki pozitif şoktan daha fazla etkilediği, kaldıraç etkisinin geçerli olduğu, şokların getiri volatilitesi üzerinde asimetrik etkide bulunduğu ve şokların uzun hafıza özelliği gösterdiği tespit edilmiştir. Diğer taraftan,

$(\alpha_1 + \beta_1)$ ölçüsü, volatilité ısrarcılığını göstermektedir. Bu durum, herhangi bir dönemde meydana gelen bir şokun etkisinin gelecekte de bir süre daha devam ettiğini göstermektedir. Endekste belirlenen volatilitenin gün bazında ne kadar sürdüğünü belirleyebilmek için HL (half-life) ölçüsü $HL = \ln(0.5) / \ln(\alpha_1 + \beta_1)$ eşitliği esas alınarak tespit edilebilmektedir. HL hesaplamaları neticesinde BIST100 endeksine gelen bir şokun etkisi yaklaşık 86.29 gün sürdüğü belirlenmiştir. Bu ölçü, şokun süresinin yanı sıra şokun üzerinden atma ve tepkisini de göstermektedir. Tahmin edilen APGARCH modeli sonrası BIST100 endeks getirilerine ilişkin elde edilen koşullu varyans grafiğı Şekil 3'te gösterilmektedir.

Şekil 3. BIST-100 Endeksinin Koşullu Varyansı



Koşullu varyans grafiğı incelendiğinde, 05.01.2000-13.09.2018 periyodunda varyans, en yüksek değerini 2001 yılının ilk çeyreğinde elde etmiştir. 2001 Şubat ayında patlak veren yerel kriz, Türkiye'nin majör piyasası konumunda olan BIST100 endeksi üzerinde büyük bir etki yarattığı görülmektedir. İlgili dönemde 2008 ve 2013 yıllarında da varyansın yüksek olduğu gözlemlenmektedir. Bu bağlamda, ABD kaynaklı 2008 küresel finansal krizinin ve 2013 yılında ülke içerisinde yaşanan gezi olaylarının piyasayı etkilediği söylenebilir.

5.SONUÇ

Zaman serisi içerisinde bir değişkenin ortalamadan sapsması diğér bir deyişle, ortalama değere göre yüksek düzeyde artış veya azalış göstermesi volatilité olarak karşımıza çıkmaktadır. Finansal piyasalarda volatilité yatırımcılar açısından ciddi bir risk unsurudur. Dolayısıyla, finansal piyasaların volatilité yapılarının modellenmesi ve politik, ekonomik ve finansal şokların piyasalara olan etkisi, bu

şokların piyasalarda kalma süresi ve uzun hafıza niteliğinde olup olmadığının tespit edilmesi önem arz etmektedir.

Bu bağlamda çalışmada, simetrik ve asimetrik koşullu varyans modelleri ile Borsa İstanbul (BIST) 100 endeks getirisinin 05.01.2000-13.09.2018 dönemine ait volatilité tahminlemesini yapmak amaçlanmıştır. Bu doğrultuda endeks getiri serisine ilişkin en uygun ARMA modeli belirlenerek serinin simetrik-asimetrik durumu analiz edilmiştir. Serinin simetrik durumu doğrusal ARCH ve GARCH modelleri ile incelenirken; asimetrik durumu ise EGARCH, APGARCH ve TGARCH modelleri ile araştırılmıştır. BIST 100 Endeksi volatilité tahmini için serinin birim kök, otokorelasyon, değişen varyans ve seride doğrusal olmayan unsurların olup olmadığının incelenmesi ön koşullardır. Dolayısıyla, volatilité modellemesi için incelenen serinin durağan olması ve olası otokorelasyon ve değişen varyans sorunlarını giderebilmesi gerekmektedir. Çalışmada gerçekleştirilen volatilité modellemesi neticesinde, endeks getiri serisinin durağan olduğu, seride otokorelasyon ve değişen varyans sorunlarının ise giderildiği tespit edilmiş ve volatilité tahminlemesi yapılmıştır. Volatilité tahmin sonuçlarına göre, volatilité tahminlemesinde BIST100 endeksi için en uygun modelin APGARCH (1,1) olduğu ortaya çıkarılmıştır. APGARCH modelinin geçerli olabilmesi için α_i , β_i ve γ_1 katsayılarının anlamlı ve sıfırdan büyük olması, ARCH ve GARCH katsayıları toplamının da 1'den küçük olması gerekmektedir. APGARCH (1,1) modelinde hesaplanan katsayılar ve anlamlılık düzeyleri bu koşulları sağlamaktadır. APGARCH (1,1) asimetrik modelde kaldıraç parametresi (γ_1), pozitif ve anlamlı bulunmuştur. BIST100 endeksinde meydana gelen negatif bir şokun, endeksi aynı büyüklükteki pozitif şoktan daha fazla etkilediği, kaldıraç etkisinin geçerli olduğu, şokların getiri volatilitesi üzerinde asimetrik etkide bulunduğu ve şokların uzun hafıza özelliği gösterdiği tespit edilmiştir. BIST100 endeksine gelen bir şokun etkisinin de yaklaşık 86.29 gün sürdüğü belirlenmiştir. Ayrıca endeks serisinde incelenen periyotta en yüksek koşullu varyans değerleri, 2001, 2008 ve 2013 yıllarında tespit edilmiştir. Bu dönemlerde gerçekleşen finansal krizler ve ülke içerisinde yaşanan iç sıkıntılar varyansın bu dönemlerdeki yüksek değerlerini açıklamaktadır.

KAYNAKÇA

- Akar, C. (2007) "Volatilité Modellerinin Öngörü Performansları: ARCH, GARCH ve SWARCH Karşılaştırması", Dokuz Eylül Üniversitesi İşletme Fakültesi Dergisi, 8(2): 201-2017.
- Atakan, T. (2009) "İstanbul Menkul Kıymetler Borsasında Değişkenliğin (Volatilitenin) ARCH-GARCH Yöntemleri İle Modellenmesi", İstanbul Üniversitesi İşletme Fakültesi İşletme İktisadi Enstitüsü Dergisi, 62: 48-61.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Bollerslev, T. (1986) "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity", *Journal of Econometrics*, 37: 307-327.
- Brock, W., Dechert, W. and Scheinkman, J. (1987) "A Test for Independence Based on the Correlation Dimension", University of Wisconsin at Madison, Department of Economics Working Paper.
- Çabuk, H.H., Özmen, M. ve Kökçen A. (2011) "Koşullu Varyans Modelleri: İMKB Serileri Üzerine Bir Uygulama", *Çukurova Üniversitesi İİBF Dergisi*, 2(15): 1-18.
- Çalışkan Çavdar, Ş. ve Aydın, A.D. (2017) "Borsa İstanbul Kurumsal Yönetim Endeksi'nde (XKURY) Volatilitenin Etkisi: ARCH, GARCH ve SWARCH Modelleri İle Bir İnceleme" *Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 22(3): 697-711.
- Elsheikh, M.A. ve Sulıman, Z. (2011) "Modelling Stock Market Volatility Using GARCH Models: Evidence From Sudan", *International Journal Business and Social Science*, 2(23): 114-125.
- Engle, R.F. (1982) "Autoregressive Conditional Heteroskedasticity with Estimates of the Variance of the United Kingdom Inflation", *Econometrica*, 50(4) July: 987-1007.
- Gabriel, A.S. (2012) "Evaluating the Forecasting Performance of GARCH Models: Evidence from Romania", *Procedia-Social and Behavioral Sciences*, 62: 1006-1010.
- Goudarzi, H. ve Ramanarayanan, C.S. (2010) "Modelling and Estimation of Volatility in the Indian Stock Market", *International Journal of Business and Management*, 5(2): 85-98.
- Gürsoy, M. ve Balaban, M.E. (2014) "Hisse Senedi Getirilerindeki Volatilitenin Tahmin Edilmesinde Destek Vektör Makinelerine Dayalı GARCH Modellerinin Kullanımı", *Kafkas Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 5(8): 167-186.
- Karabacak, M., Meçik, O. ve Genç, E. (2014) "Koşullu Değişen Varyans Modelleri ile BİST 100 Endeks Getirisi ve Altın Getiri Serisi Volatilitelerinin Tahmini", *Uluslararası Alanya İşletme Fakültesi Dergisi*, 6(1):79-90.
- Karmakar, M. (2005) "Modelling Conditional Volatility of the Indian Stock Markets", *VIKALPA*, 30(3): 21-37.
- Kılıç, M.B., Çelik, İ. ve Kaya, M. (2017) "Pay Piyasalarında Getiri Volatilitelerinin Modellenmesi: BİST-100 İçin Klasik ve Bayesci GARCH Yaklaşımları", *Business and Economics Research Journal*, 8(4): 715-726.
- Koy, A. ve Ekim, S. (2016) "Borsa İstanbul Sektör Endekslerinin Volatilitelerinin Modellemesi", *Trakya Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi E-Dergi*, 5(2): 1-23.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Kula, V. ve Baykut, E. (2017) "BİST Banka Endeksi'nin (XBANK) Volatilite Yapısının Markov Rejim Değişimi GARCH Modeli (MSGARCH) ile Analizi", Bankacılar Dergisi, 102: 89-110.
- Kuzu, S. (2018) "Borsa İstanbul Endeksi (BİST 100) Getiri Volatilesinin ARCH Ve GARCH Modeli İle Tahmin Edilmesi", Muhasebe ve Vergi Uygulamaları Dergisi, Nisan Özel Sayı: 608-624.
- Özden, Ü.H. (2008) "İMKB Bileşik 100 Endeksi Getiri Volatilesinin Analizi", İstanbul Ticaret Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 13: 339-350.
- Sarıoğlu, S.E. (2006) "Değişkenlik Modelleri ve İMKB Hisse Senetleri Piyasası'nda Değişkenlik Modellerinin Kesitsel Olarak İrdelenmesi", İstanbul: İAV Yayınları.
- Şahin, Ö., Öncü, M.A. ve Sakarya, Ş. (2015) "BİST 100 ve Kurumsal Yönetim Endeksi Volatilitelerinin Karşılaştırmalı Analizi", C.Ü. İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, 16(2): 107-126.
- Şencan, İ. (2017) "BİST Altın Endeksi Oynaklığı Analizi ve Performans Ölçümü", Maliye ve Finans Yazıları, 107: 9-24.
- Tamilselvan, M. ve Vali, S.M. (2016) "Forecasting Stock Market Volatility-Evidence From Muscat Security Market Using GARCH Models", International Journal of Commerce and Finance, 2(1): 37-53.
- Tuna, K.ve İsabetli, İ. (2014) "Finansal Piyasalarda Volatilite ve Bist-100 Örneği", Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 27: 21-31.
- Yıldız, B. (2016) "Oynaklık Tahmininde Simetrik ve Asimetrik GARCH Modellerinin Kullanılması: Seçilmiş BİST Alt Sektör Endeksleri Üzerine Bir Uygulama", Muhasebe ve Finansman Dergisi, Ekim: 83-106.

EĞİTİM VE YOKSULLUK İLİŞKİSİ

Prof. Dr. Erdal Tanas KARAGÖL*

Araş. Görv. Didem KOCA**

Buşra İLGÜN***

ÖZET

Bu çalışmada, eğitimin yoksullukla olan ilişkisi incelenmektedir. Öncelikle dünyadaki ve Türkiye'deki yoksulluk oranları ele alınmaktadır. Daha sonra dünyadaki ve Türkiye'deki eğitim seviyeleriyle yoksulluk oranları bakılarak yoksulluk ve eğitim arasındaki ilişki ortaya koymaya çalışılmıştır. Bu çerçevede eğitime harcanan paylara bakılmıştır. Türkiye'deki eğitim ve yoksulluk ilişkisi incelenirken, bu ilişkinin cinsiyet, kırsal, kent kapsamındaki boyutları ele alınmıştır. Ayrıca, Türkiye'de bireyleri yoksulluğa sürükleyen nedenlere değinilmiştir. Son olarak sonuç ve değerlendirme kısmında yoksulluğu azaltmak için yapılan eğitim politikaları ve bu politikaların etkinliğinden bahsedilmiştir.

Anahtar Kelimeler: Eğitim, Yoksulluk, Eğitim Politikaları

RELATIONSHIP BETWEEN EDUCATION AND POVERTY

In this study, the relationship between education and poverty is examined. Then, with the education level in the world and education level in Turkey, poverty rates were examined and attempted to show the relationship between poverty and education. In this context, the shares spent on education were examined. Later, the study continued through Turkey. The relationship between education and poverty in Turkey is addressed as gender, rural, and urban. In addition, the reasons that lead to poverty are mentioned in Turkey. Finally, in the conclusion and Evaluation Section, education policies and the effectiveness of these policies were It has been mentioned reduce poverty.

Key words: Education, Poverty, Educational Policy.

* Prof. Dr., Ankara Yıldırım Beyazıt Üniversitesi, Siyasal Bilgiler Fakültesi, İktisat Bölümü, Ankara-Türkiye, erdalkaragol@hotmail.com

** Araş. Görv., Ankara Yıldırım Beyazıt Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Ankara-Türkiye, didem_koca@hotmail.com

*** Araş. Görv., Ankara Yıldırım Beyazıt Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Ankara-Türkiye, busrailgun@gmail.com

1.GİRİŞ

İnsanların hayatlarını onurlu bir biçimde devam ettirebilecekleri imkânlardan yoksun olması, asgari yaşam düzeyinin altında yaşamaları, temel ihtiyaçları karşılayamama gibi ifadelerle tanımlanan yoksulluk kavramı, akademik literatürde de sıklıkla araştırma konusu olmuştur. Geçmişten günümüze tüm dünyanın kanayan yarası olan “yoksulluk” üzerine birçok çözüm üretilmiş ve projeler kapsamında yoksulluk oranları düşürülmeye çalışılmıştır. Ancak henüz bu çözümler tam anlamıyla bir gerçeklik kazanamamış, aksine yoksul insanlarla zengin insanlar arasındaki uçurum gitgide açılmıştır.

Yoksulluğa sebep olan birçok faktör mevcuttur. Bunlar arasında ön plana çıkanlar ise; ekonomik, işsizlik, göç, cinsiyet ve de eğitimidir. Yoksulluk olgusu tüm yönleriyle incelendiğinde, en önemli nedenin eğitimden kaynaklandığı söylenebilir. Bu bağlamda eğitimin ekonomi ve işsizlikle doğrudan ilişkili olduğu ifade edilebilir.

“Eğitim, ekonomik ve toplumsal bölüşüm süreçlerinde en belirleyici unsurlardan biridir”(Alpaydın, 2008, s. 50). Eğitimle yoksulluk arasında kısır bir döngü mevcuttur. Yoksulluğun artmasıyla istenilen eğitimi alabilmek zorlaşmakta eğitim düzeyi düşükçe de yoksulluk artmaktadır, bu durum içinden çıkılmaz bir hal almaktadır (Alpaydın, 2008).

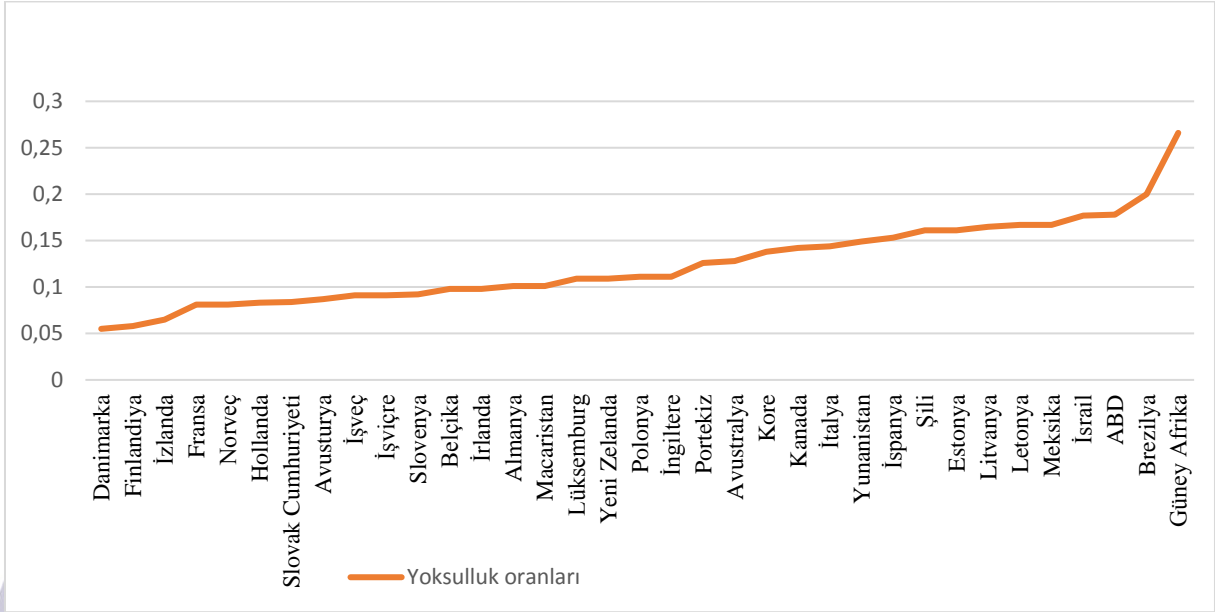
Bu çalışmada eğitimin bireysel ve toplumsal getirileri yoksullukla ilişkisi ele alınacak, eğitim düzeyi ve yoksulluğa ait veriler analiz edilip, eğitim harcamalarına değinilecektir. Çalışmanın son bölümünde ise bu konu ile ilgili olarak devlet politikalarına yer verilecektir.

2. DÜNYA VE TÜRKİYE’DE EĞİTİMİN YOKSULLUKLA İLİŞKİSİ

Dünyada olduğu gibi Türkiye’de de yoksulluk başat sorunlardan biridir. Hem uluslararası kuruluşların hem de ulusal kuruluşlar, yoksulluğun azaltılmasında ve önüne geçilmesinde etkili olacak politikalar üzerinde titizlikle çalışmaktadır. Devlet vatandaşlarını korumakla görevlidir. Devlet bütün vatandaşlarının eşit şartlara sahip olabilmesi için, yoksulluk oranlarının düşürülmesi gerekmektedir. İnsan onuruna yaraşır bir biçimde yaşama hakkı anayasal bir hak olmakla birlikte İnsan Hakları Evrensel Bildirgesinin 22. Maddesinde de şu şekilde açıklanmıştır:

“Madde 22- Herkesin, toplumun bir üyesi olarak, sosyal güvenliğe hakkı vardır. Ulusal çabalarla ve uluslararası işbirliği yoluyla ve her devletin örgütlenmesine ve kaynaklarına göre, herkes onur ve kişiliğinin serbestçe gelişim için gerekli olan ekonomik, sosyal ve kültürel haklarının gerçekleştirilmesi hakkına sahiptir.”

Grafik 1. Dünyada Yoksulluk Oranları



Kaynak: OECD, 2015

Grafik 1’de dünyadaki yoksulluk oranlarına yer verilmiştir. Bu kapsamda yoksulluk oranları hesaplanırken “gelirleri yoksulluk sınırının (toplam nüfusun medyan hane gelirinin yarısı olarak alınır) altına düşen insan sayısının oranı” baz alınmıştır. Dünyada en az yoksulluk oranına sahip ülke sıralamasına bakıldığında; 0,055 ile Danimarka, 0,058 ile Finlandiya ilk sıralarda yer alırken, bu ülkeleri Fransa ve Norveç izlemektedir. Bu kapsamda en az yoksulluğun yaşandığı ülkelerin genel olarak İskandinav ülkeleri olduğu söylenebilir. En yüksek yoksulluk oranına sahip ülke ise, 0,266 ile Güney Afrika ülkesidir. İkinci en yüksek yoksulluk oranına sahip ülke ise 0,200 ile Brezilya’dır.

Dünyadaki yoksulluk oranları incelendiğinde ülkeler arasındaki uçurumun bu denli açık olması için etkili ve verimli politikaların üretilmesine ihtiyaç vardır. Bu politikaların başında da eğitim düzeyinin yükseltilmesi gelmektedir. Söz konusu yoksulluk oranlarının görece düşük ülkelerde eğitim düzeyinin yükseltilmesi yoksulluk oranlarının düşmesini sağlayacaktır. Bu bağlamda, çalışmada, eğitimin yoksulluğu düşürmede nasıl etkili olacağı ve yoksulluğun nasıl düşürülebileceği sorularına cevap aranacaktır.

Yapılan araştırmalar incelendiğinde, ekonomik anlamda orta sınıfta yer alan insanların eğitime daha çok önem verdiği gözlemlenirken; alt sınıftaki insanların eğitime daha az önem verdiği gözlemlenmiştir. “Avrupa’da mobilite düşüktür ve eğitimde de alt sınıftan gelen ailelerin çocuklarının ebeveynleri ile benzer bir kaderi paylaştıkları ifade edilir”(Alpaydın, 2008: 54).

Tablo 1. AB Ülkelerinde Eğitim Düzeyine Göre Şiddetli Maddi Yoksunluk oranı (18 yaş ve üstü nüfus)

| Ülkeler | Eğitim Seviyeleri | | |
|-----------------|-------------------|---------------------|---------------|
| | İlköğretim | Ortaöğretim ve Lise | Yükseköğretim |
| Çek Cumhuriyeti | 11,5 | 3,1 | 0,7 |
| Danimarka | 5,0 | 2,7 | 2,3 |
| Almanya | 7,6 | 3,3 | 1,8 |
| Estonya | 7,7 | 5,2 | 1,8 |
| Yunanistan | 27,3 | 21,7 | 8,3 |
| İspanya | 6,8 | 4,5 | 1,8 |
| Fransa | 6,6 | 3,9 | 1,0 |
| Hırvatistan | 10,0 | 9,0 | 2,6 |
| İtalya | 14,1 | 8,1 | 3,2 |
| Kıbrıs | 14,8 | 13,2 | 4,9 |
| Letonya | 22,4 | 12,7 | 3,8 |
| Litvanya | 23,5 | 13,9 | 4,3 |
| Lüksemburg | 2,2 | 0,8 | 0,4 |
| Macaristan | 29,4 | 11,1 | 3,4 |
| Malta | 4,5 | 1,4 | 0,7 |
| Hollanda | 3,8 | 3,0 | 1,2 |
| Avusturya | 7,9 | 3,0 | 1,1 |
| Polonya | 12,8 | 6,2 | 1,3 |
| Portekiz | 9,4 | 3,9 | 1,1 |
| Romanya | 31,7 | 16,0 | 4,3 |
| Slovenya | 11,5 | 4,6 | 1,0 |
| Slovakya | 22,9 | 5,3 | 1,3 |
| Finlandiya | 3,9 | 2,3 | 0,5 |
| İsveç | 1,9 | 0,9 | 0,9 |
| Norveç | 5,6 | 1,6 | 1,6 |

Kaynak: Eurostat. (2017). Education Statistics. Population and Social Conditions.

Tablo 1’ de Avrupa Birliği’ndeki ülkelerinin eğitim ve yoksulluk ilişkilerine yer verilmiştir. Tablo 1’ de, ilköğretimden mezun olan bireylerin yoksulluk oranları incelendiğinde; en az yoksulluk oranına sahip ülkeler; İsveç 1.9, Lüksemburg 2.2, Hollanda 3.8’le yer alırken; en yüksek yoksulluk oranına sahip ülkeler; Macaristan 29.4, Yunanistan 27.3, Litvanya 23.5 yer almaktadır. Ortaöğretim ve liseden mezun olan bireylerin yoksulluk oranlarına bakıldığında; en az yoksulluk oranına sahip ülkeler; Lüksemburg 0.8, İsveç 0.9, Malta 1.4, yer alırken; en yüksek yoksulluk oranına sahip ülkeler; Yunanistan 21.7, Romanya 16.0, Litvanya 13.9 yer almaktadır. Yükseköğretimden mezun olanların yoksulluk oranları incelendiğinde; en az yoksulluk oranına sahip ülkeler; Finlandiya 0.5, Malta 0.7, İsveç 0.9 yer alırken; en yüksek yoksulluk oranına sahip ülkeler; Yunanistan 8.3, Kıbrıs 4.9, Litvanya 4.3 yer almaktadır. Tablo 1 genel olarak incelendiğinde, en düşük yoksulluk oranına sahip ülke İsveç olmakla birlikte, bu ülkeyi sırasıyla Finlandiya ve Norveç takip etmektedir. Bu bağlamda yoksulluğun en düşük olduğu ülkeler İskandinav Ülkeleridir. Yoksulluğun en yüksek seviyede olduğu Avrupa Ülkesi

ise; Yunanistan'dır. Bütün Avrupa Ülkelerine bakıldığında yoksullukla ilgili olarak hepsinde eğitim seviyesi artığında, yoksulluğun azaldığı söylenebilmektedir.

Tablo 2. Ülkelerin Eğitime Harcamış Oldukları Paylar (GSYİH %)

| Ülkeler | Okul Öncesi | İlköğretim | Ortaöğretim | Lise | Yükseköğrenim |
|-----------------|-------------|------------|-------------|------|---------------|
| Çek Cumhuriyeti | 0,52 | 0,80 | 1,84 | 2,6 | 1,16 |
| Letonya | 0,83 | 1,63 | 1,64 | 3,3 | 1,51 |
| Litvanya | 0,81 | 0,72 | 1,59 | 2,4 | 1,50 |
| Yunanistan | - | 1,30 | 1,53 | 2,9 | 0,99 |
| İrlanda | 0,07 | 1,42 | 1,12 | 2,6 | 0,82 |
| Polonya | 0,74 | 1,58 | 1,60 | 3,2 | 1,37 |
| İtalya | 0,54 | 1,07 | 1,88 | 3,0 | 0,92 |
| Estonya | 1,19 | 1,35 | 1,41 | 3,0 | 1,77 |
| Macaristan | 0,86 | 0,78 | 1,80 | 2,9 | 0,88 |
| İspanya | 0,79 | 1,34 | 1,73 | 3,1 | 1,28 |
| Portekiz | 0,61 | 1,57 | 2,37 | 3,9 | 1,29 |
| Fransa | 0,74 | 1,18 | 2,54 | 3,7 | 1,46 |
| Hollanda | 0,39 | 1,21 | 2,42 | 3,6 | 1,73 |
| Slovenya | 1,13 | 1,54 | 1,74 | 3,3 | 1,04 |
| İngiltere | 0,50 | 1,99 | 2,37 | 4,4 | 1,87 |
| Kanada | - | 2,06 | - | 3,5 | 2,45 |
| Avusturya | 0,65 | 0,91 | 2,19 | 3,1 | 1,74 |
| Almanya | 0,87 | 0,64 | 2,15 | 3,0 | 1,22 |
| Danimarka | 1,26 | 2,11 | 2,69 | 4,8 | 1,69 |
| ABD | - | 1,64 | 1,85 | 3,5 | 2,58 |
| Finlandiya | 1,24 | 1,44 | 2,56 | 4,0 | 1,73 |
| İzlanda | 1,71 | 2,24 | 2,26 | 4,5 | 1,28 |
| İsveç | 1,92 | 1,76 | 1,86 | 3,6 | 1,62 |
| Norveç | 1,82 | 2,13 | 2,47 | 4,10 | 1,74 |

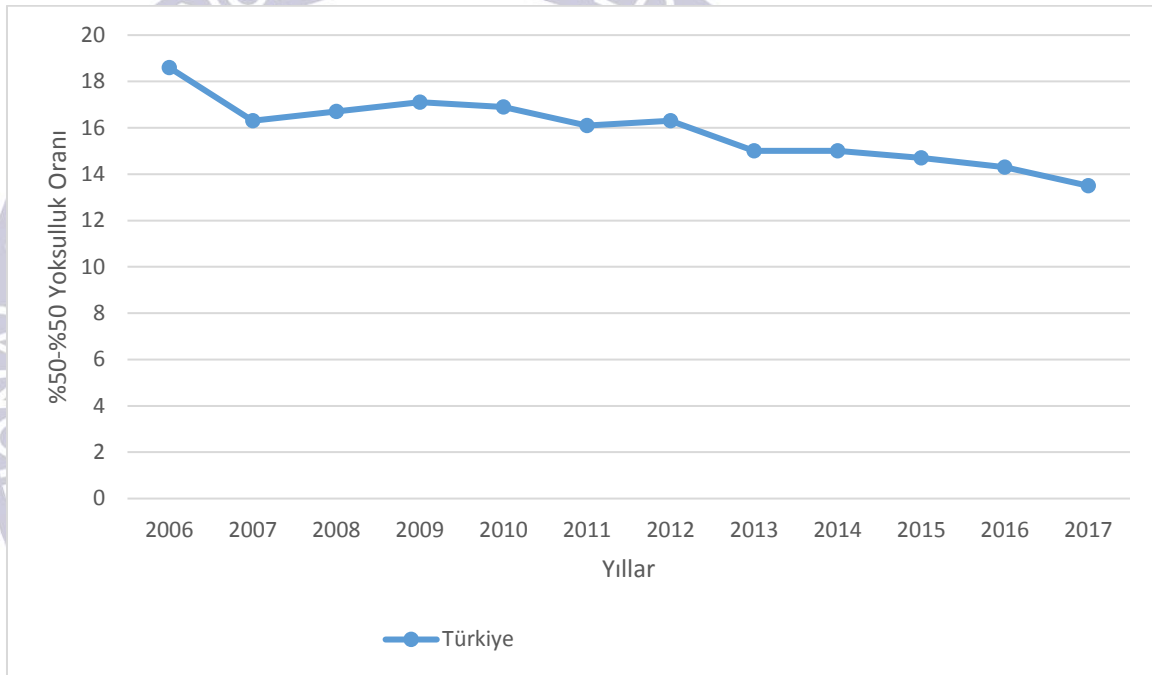
Kaynak: OECD, 2015

Tablo 2'de görüldüğü üzere, AB ülkelerinin geneline baktığımızda, özellikle İskandinav ülkelerinin eğitim harcamalarına diğer ülkelere kıyasla daha fazla pay ayırdıkları görülmektedir. Sırasıyla İsveç ve Norveç'in okul öncesi eğitime ayırdıkları payların GSYİH'ya oranı 1.92 ve 1.82'dir. Diğer yandan okul öncesi eğitime en az payı olan ülkelerin başında ise İrlanda ve Çek Cumhuriyeti gelmektedir. İlköğretim eğitimine en fazla pay ayıran ülkeler İzlanda 2.24 ve Norveç 2.13'dur. En az pay ayıran ülkeler ise, Litvanya 0.72 ve Macaristan 0.78 pay ayırmaktadır. Ortaöğretime ayrılan eğitim payları incelendiğinde, en fazla eğitime pay ayıran ülkeler, Danimarka 2.69 ve Finlandiya 2.56 pay ayırırken; en az eğitime pay ayıran ülkeler, İrlanda 1.12 ve Estonya 1.41 pay ayırmaktadır. Liseye ayrılan eğitim paylarına bakıldığında, en fazla eğitime pay ayıran ülkeler, Norveç 4.10 ve Danimarka 4.8 pay ayırırken; Litvanya 2.4, Çek Cumhuriyeti ve İrlanda 2.6 ile en az pay ayıran ülkeler arasında yer almaktadır. Yükseköğrenime ayrılan eğitim payları incelendiğinde, en fazla eğitime pay ayıran ülkeler ABD 2.58 ve Kanada 2.45 yer alırken; en az eğitim harcaması yapan ülkeler, İrlanda 0.82 ve İtalya 0.92

yer almaktadır. Böylelikle de eğitimdeki artış sayesinde, yoksulluk oranlarında dikkate değer düşüşlerin yaşanması söz konusu olmaktadır. Türkiye’de ise bu durum TÜİK (2016) eğitim harcamaları istatistikleri raporuna göre, eğitim harcamalarının GSYİH’deki payı her geçen yıl artış göstermektedir. 2015 yılında GSYİH oranı 5.8 iken bu oran 2016 yılında 6.2’ye ulaşmıştır. 2016 yılında eğitime ayrılan paylarda geçen yıla oranla en çok %31.6 ile ortaöğretime, %20,3 ile yükseköğrenime pay ayrılmıştır (TÜİK, 2017).

Grafik 2. Eşdeğer Hanehalkı Kullanılabilir Fert Gelirine Göre Hesaplanan Yoksulluk Oranı

(%50-%50)



Kaynak: TÜİK, 2017

Grafik 2’de eşdeğer hanehalkı kullanılabilir fert gelirine göre hesaplanan yoksulluk oranı (%50-%50) verilmiştir. Grafik 2’de görüldüğü üzere 2006 ile 2017 yılları arasında yoksulluk oranlarının azaldığı görülmektedir. Türkiye en yüksek 2006 yılında %18.6 yoksulluk oranına sahipken, 2017 yılında ise, yoksulluk oranı %13.5’e gerilemiştir. Türkiye’de yoksulluk oranlarının 2013 yılından sonra önemli ölçüde azalmanın yaşandığı görülmektedir.

Tablo 3. Türkiye’de Eğitim Durumlarına Göre Yoksulluk Oranları (%) (15 yaş ve üstü)

| Yıllar | | Yoksulluk Oranı % | | | | |
|--------|---------|-----------------------|------------------------|-----------------------|------------------------------|-------------------------|
| | | Okur-Yazar Olmayanlar | Bir Okul Bitirmeyenler | Lise Altı Eğitimliler | Lise ve Dengi Okul Mezunları | Yükseköğretim Mezunları |
| 2013 | %50-%50 | 26,6 | 23,7 | 12,4 | 5,6 | 1,8 |
| | %60-%60 | 37,5 | 33,5 | 20,0 | 9,1 | 2,7 |
| 2014 | %50-%50 | 27,7 | 25,1 | 12,5 | 5,7 | 1,3 |
| | %60-%60 | 38,1 | 34,2 | 19,6 | 9,3 | 2,2 |
| 2015 | %50-%50 | 27,2 | 23,7 | 12,8 | 5,6 | 1,6 |
| | %60-%60 | 36,3 | 34,1 | 20,3 | 10,2 | 2,7 |
| 2016 | %50-%50 | 26,2 | 24,1 | 12,5 | 6,2 | 1,7 |
| | %60-%60 | 35,3 | 33,5 | 19,6 | 10,4 | 3,2 |
| 2017 | %50-%50 | 25,4 | 21,7 | 11,7 | 5,5 | 1,5 |
| | %60-%60 | 35,1 | 30,9 | 18,5 | 9,6 | 3,3 |

Kaynak: TÜİK, Gelir ve Yaşam Koşulları Araştırması, 2017.

Tablo 3’ de Türkiye’deki eğitim durumuna göre yoksulluk oranları gösterilmektedir. Bu tablo genel itibariyle eğitim seviyelerinin yoksullukla ters orantılı olduğunu ifade eder. Şöyle ki; okuryazar olmayanların yoksulluk oranları ile yükseköğretim mezunlarının yoksulluk oranları arasında önemli bir fark söz konusudur. Okuryazar olmayan bireylerin yoksulluk oranları ortalama %20 düzeylerinde iken yükseköğretim mezunlarındaki yoksulluk oranları ise ortalama %1 düzeyindedir. Avrupa ülkelerinde olduğu gibi Türkiye’de de eğitim ve yoksulluk arasında ters orantı vardır yani eğitim seviyesi arttıkça yoksulluk azalmaktadır.

2013-2017 yılları arasında eğitim seviyeleri her sene genel olarak artmışken; buna nazaran her yıl eğitim seviyesi yüksek olanlar da yoksulluk oranlarında azalış meydana geldiği gözlenmektedir. 2013

yılında yoksulluk oranlarına bakıldığında, okur-yazar olamayan %26,6 iken; bu oran 2017'de %25,4'e düşmüştür. 2013'de yükseköğrenim mezunları %1,8 iken; bu oran 2017'de %1,5 gerilemiştir.

Yükseköğrenimden mezun olan yoksulluk oranı 2017 yılında %1,5 düzeyinde gerçekleşmiştir. Bu durum, 2017 yılının yükseköğrenimden mezun olan işsizlerin oranıyla da ifade edilebilmektedir. Bu doğrultuda bakıldığında, TÜİK verilerine göre 2017 yılında yükseköğrenimden mezun olanların işsizlik oranı 12,7'dir. Yükseköğrenimden mezun olan ancak yoksullukla karşı karşıya kalan bireylerin en önemli sorunu, yapısal işsizliktir. Yapısal işsizlik, bireylerin sahip oldukları nitelik ve donanımlara eşdeğer bir işi işgücü piyasaları içinde bulamamalarından kaynaklanan bir işsizlik türü olarak ifade edilir. Türkiye'de oldukça yaygın olarak görülen işsizlik türlerinden birisidir.

Yoksulluğun önüne geçilebilmesinin ya da yoksulluk oranlarının en düşük seviyelerde kalmasını sağlamanın en önemli diğer bir koşulu ise, eğitimle doğru orantılı olarak istihdam düzeylerinin artırılmasından geçmektedir. Bu kapsamda işverenin ihtiyaç duyduğu niteliklerle bireyin sahip olduğu niteliklerin örtüşmemesi en temel meseledir. Dolayısıyla emek arz ve talep noktasındaki bu uyumsuzluğun giderilmesi esastır.

Tablo 4. Türkiye'de Cinsiyet, Eğitim ve Yoksulluk Oranları (%)

| Eğitim Düzeyi | Türkiye | | | Kent | | | Kır | | |
|---|---------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | Toplam | Erkek | Kadın | Toplam | Erkek | Kadın | Toplam | Erkek | Kadın |
| 6 Yaşından Küçük Fertler | 24,04 | 22,87 | 25,27 | 13,01 | 12,20 | 13,88 | 48,69 | 47,48 | 49,92 |
| Okur-Yazar Değil ya da Bir Okul Bitirmeyenler | 29,84 | 20,34 | 29,52 | 16,13 | 16,59 | 15,82 | 48,83 | 51,01 | 47,57 |
| İlkokul | 15,34 | 16,86 | 13,83 | 7,23 | 7,88 | 6,65 | 31,02 | 32,18 | 29,67 |
| Ortaöğretim | 17,77 | 17,19 | 18,39 | 8,46 | 8,44 | 8,49 | 37,98 | 36,48 | 39,55 |
| Orta Okul ve Orta Okul Meslek | 9,76 | 10,89 | 7,82 | 5,81 | 6,04 | 5,46 | 24,41 | 25,03 | 22,43 |
| Lise ve Lise Dengi Meslek | 5,34 | 5,31 | 4,76 | 3,75 | 4,05 | 3,30 | 14,65 | 14,15 | 15,72 |
| Yüksek Okul, Fakülte ve Üstü | 0,71 | 0,92 | 0,40 | 0,48 | 0,64 | 0,24 | 3,37 | 3,70 | 2,68 |

Kaynak: TÜİK, 2009

Tablo 4'de Türkiye'de cinsiyet, eğitim ve yoksulluk oranlarına yer verilmiştir. Bu kapsamda yoksulluk olgusu ve oranlarını ifade ederken tek bir neden ile açıklamak mümkün değildir. Dolayısıyla yoksulluğun eğitim, cinsiyet ve bireyin yaşadığı bölge anlamında yoksulluğu incelemek, yoksulluğun

detayları ve nedenleri hakkında daha gerçekçi bir tablonun ortaya çıkmasını sağlayacaktır. Tablo 4 incelendiğinde, kırsal kesimde yaşayanlara kıyasla kentlerde daha az yoksul bireylerin bulunduğu söylenebilir. Özellikle okur-yazar olmayanların kırsal kesimdeki yoksulluk oranı %48,83'dur. Bu oran kentlerde ise, %16,13'dur. Bunun sebebi de kentlerde eğitim fırsatlarına erişimin, kırsala göre daha avantajlı olmasından kaynaklanmaktadır.

Kırsal kesimde yaşayanların eğitimlerine bakıldığında, okullardaki sınıf mevcudunun fazlalığı bunların dışında düzenli aile ortamlarının olmaması, beslenme, sağlık sorunları da nitelik olarak eğitimi etkileyen sebeplerdendir (Kalaycıoğlu & Çelik, 2011). Cinsiyet bağlamında yoksulluk oranlarına bakıldığında ise erkeklerin yoksulluk oranı kadınların yoksulluk oranlarına göre daha düşüktür. Kadın yoksulluk oranlarına bakılacak olursa, “kadınların, toplumsal yaşamdan uzak olmaları, (özellikle eğitim ve çalışma yaşamlarında) kadınların gelir dağılımında en yoksul kitle olmasını da beraberinde getirmektedir” (Öztürk & Çetin, 2009, s. 2671). Kentlerde yaşayan kadınların yoksulluk oranı kırsal kesimde yaşayan, kadınlara oranla daha düşüktür. Kırsal kesimdeki kadınların yoksulluk oranlarının yüksek düzeyde olmasının en temel nedeni “ücretsiz aile işçiliğidir”. Ücretsiz aile işçiliği, kadınların, gelir düzeylerini düşük göstermektedir.

Türkiye genelinde ilkokul ve ortaokula düzeyinde eğitime bakıldığında, kadın ve erkek yoksulluk oranlarının birbirine yakın olduğu söylenebilmektedir. İlkokulda kadın yoksulluk oranı %13,83'dur. Bu oran erkeklerde %16,86'dır. Burada kadınların yoksulluk oranının erkeklere nazaran daha düşük çıkmasının sebebi olarak ise kadınların daha çok, vasıfsız ve düşük ücretli işlerde çalışıyor olmasından kaynaklandığı söylenebilir. Çünkü kadınların bu işleri tercih etmeleri erkeklere oranla daha fazladır.

Yoksulluğun bir diğer sebebi de “kalabalık aile” olmaktır. Çünkü ailelerde ki fert sayısı artıkça, yoksulluk oranları da artmaktadır. Yoksulluğu azaltmada etkili olan eğitime ulaşmada bu kalabalık ailelerin bir etkisi var mıdır? Elbette ki bir etkisi vardır. Tek hane gelirine sahip olan bir ailede okuyan çocuk sayısının fazla olması ve buna karşılık eğitiminde masraflı olması eğitime yeteri kadar pay ayrılmasına engel olmaktadır. Bir başka deyişle, çalışan bir kişi gelir durumuna göre eğitime ayıracağı kaynağı da belirlemektedir. Örneğin, her iki ebeveynin çalıştığı hanehalkında eğitime ayıracağı pay ile tek bir ebeveynin çalıştığı hanehalkında eğitime ayrılan pay farklı olacaktır. (ECR, 2005 aktaran Yolcu, 2011).

Tablo 5. Eşdeğer Hanehalkı Kullanılabilir Fert Gelirine ve Hanehalkı Tipine Göre Yoksulluk Sayıları ve Yoksulluk Oranı (2017)

| Hanehalkı Tipi | Yoksulluk Sınırı(TL) | Yoksulluk Sınırı (Bin kişi) | Yoksulluk Oranı (%) |
|---|----------------------|-----------------------------|---------------------|
| Toplam | 7 944 | 10 622 | 13,5 |
| Tek Kişilik Hanehalkı | 7 944 | 296 | 8,2 |
| 65 Yaşın Altında | 7 944 | 111 | 5,4 |
| 65+Yaş | 7 944 | 185 | 11,9 |
| Erkek | 7 944 | 93 | 6,4 |
| Kadın | 7 944 | 203 | 9,4 |
| Bağımlı Çocuğu Olmayan Hanehalkı | 7 944 | 714 | 3,8 |
| İki Yetişkinli; Yetişkinlerin İki de 65 Yaşın Altında | 7 944 | 151 | 2,6 |
| İki Yetişkinli; Yetişkinlerden En Az Biri 65 ve Daha Fazla Yaşta | 7 944 | 219 | 6,6 |
| Bağımlı Çocuğu Olmayan Diğer Hanehalkı | 7 944 | 344 | 3,6 |
| Bağımlı Çocuğu Olan Hanehalkı | 7 944 | 9 612 | 17,0 |
| Tek Yetişkin, En Az Bir Bağımlı Çocuğu Olan | 7 944 | 209 | 17,9 |
| İki Yetişkinli, Bir Bağımlı Çocuğu Olan | 7 944 | 310 | 3,8 |
| İki Yetişkinli, İki Bağımlı Çocuğu Olan | 7 944 | 790 | 6,6 |
| İki Yetişkinli, Üç ve Daha Fazla Bağımlı Çocuğu Olan | 7 944 | 4 075 | 34,3 |
| Bağımlı Çocuğu Olan Diğer Hanehalkı | 7 944 | 4 228 | 18,1 |
| Hanehalkı Tipi Belirlenemeyen | 7 944 | 0 | 0 |

Kaynak: TÜİK, 2017

Tablo 5’ de eşdeğer hanehalkı kullanılabilir fert gelirine ve hanehalkı tipine göre yoksulluk sayıları ve yoksulluk oranları verilmiştir. Tablo 5’de görüldüğü üzere çekirdek aileler daha az yoksulluk yaşarken, aile içindeki fert sayısı arttıkça yani aileler kalabalıklaştıkça yoksulluk oranları da artmaktadır. Bu durum hane içerisinde çalışan sayısı ile açıklanabilir.

Genellikle Türkiye’de ücretli kadın çalışanların sayısı erkek çalışan sayısına oranla daha düşüktür. Bu durum, çocukların eğitimden koparılması ya da hiç eğitime başlayamaması sorununu

doğurmaktadır. 2012 TÜİK Türkiye geneli verilerine göre, ekonomik işlerde çalışan çocuklar 893 bin, ev işlerinde faaliyetlerde bulunan çocuk sayısı ise 7 bin 503'tür. Bu çocukların eğitime devam edememelerinin tek sebebi, eğitim masraflarını karşılayamamasından kaynaklanmaktadır. Çocuğu okula devam edemeyen ailelerin çoğunun, eğitim seviyesinin düşük ve sosyal güvenceden yoksun olarak çalıştıkları söylenebilir (Kalaycıođlu ve Çelik, 2011). Bu bağlamda söz konusu bireylerin yoksulluğun kısır döngüsüne girmelerine engel olma noktasında alınacak tedbirler ve uygulanacak politikalar hayati önem taşımaktadır. Yoksulluğun nesilden nesille bir miras olarak bırakılmamasın tek yolu ise eğitim seviyesinin yükseltilmesinden geçmektedir.

3.SONUÇ VE DEĞERLENDİRME

Bu çalışmada, yoksulluk ve eğitim arasındaki ilişki incelenmiştir. Bu kapsamda eğitim ve yoksulluğun ters orantılı olduđu ve eğitim seviyesi yükseldikçe yoksulluğun azaldığı görülmüştür. Okuma yazma bilmeyen ve ilkokul mezunu bireylerin yoksulluk oranı ile yükseköğretim mezunu bireylerin yoksulluk oranları arasında önemli bir fark mevcuttur. Diğer yandan, yoksulluğun artması eğitime ulaşma fırsatlarının önünde de önemli bir engel teşkil etmektedir.

Yoksulluğun önlenmesinde en önemli hususlardan birisi, ülkelerin eğitime harcadıkları payların yüksek oranlarda olması gerekmektedir. Bu kapsamda hem dünyada hem de Türkiye'de eğitim seviyelerinin artması ve eğitime aktarılan payların yüksek olması yoksulluk oranlarında önemli ölçüde düşüşlerin yaşanmasına vesile olmaktadır.

Türkiye'de bir yandan yoksulluğun azalması diğer yandan eğitime erişim fırsatlarının artırılması anlamında önemli program ve uygulamaların gerçekleştirildiđi söylenebilir. Bunlardan en önemlisi 2001 yılında Dünya Bankası'nın desteđiyle başlatılan Şartlı Nakit Transferleridir. 2006 yılına kadar Dünya Bankası'nın desteđiyle uygulanan program, bu tarihten sonra Türkiye'nin kendi kaynaklarıyla sürdürülmektedir. ŞNT yardımlarının bu kadar yaygın olmasında ki sebep kısa vadede etkin bir yardım programı olmasıyken, uzun vadede ise kalıcı bir hedef olmasıdır.(Esenyel ve Torun, 2010).

Yukarıdaki tablolarda da görüldüğü üzere kadınların yoksulluk oranları erkeklere göre daha fazladır. Bunun bir nedeni de kadınların eğitime erişim noktasında erkeklere göre dezavantajlı bir durumda olmalarından kaynaklanmaktadır. 2001 yılında UNICEF tarafından başlatılan "haydi kızlar okula" kampanyası, kız çocuklarının okula devamında önemli bir farkındalık sağlamıştır. Bu kapsamda Türkiye'de kız çocuklarının okula gönderilme oranları artmıştır (UNICEF, 2005).

Bunların dışında yetişkin bireylerin eğitimlerine yönelik de çalışmalar yapılmaktadır. Bilindiđi üzere okuma-yazma bilmeyen bireylerin yoksulluk oranı 2017 yılında %25,4'dur ve eğitim seviyelerine göre de en fazla yoksulluk oranı okur-yazar olmayan bireyleri etkilemektedir. Bu kapsamda Şubat 2018

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

yılında başlatılan “okuma-yazma seferberliği” kampanyasına, 275 bin kişi okuma-yazma öğrenmek için başvurmuştur (<https://www.tccb.gov.tr>). 2008 yılında yapılan “ana-kız okuldayız” kampanyası da halk eğitimler de okuma-yazma bilmeyenlere, okuma-yazma dersleri verilmektedir (<http://gokcebeyhem.meb.k12.tr>).

Diğer yandan İŞKUR’un yetişkinlere yönelik kursları ve mesleki eğitim programları, bireylerin eğitim seviyesinin artırmanın yanı sıra işgücüne katılımlarını da teşvik edici niteliktedir. Girişimcilik destekleriyle ön plana çıkan KOSGEP ise bireyleri girişimcilik noktasında desteklerken, önemli oranda yeni iş imkânlarının ortaya çıkmasına da katkıda bulunmaktadır.

Türkiye ve dünyada yoksulluğu azaltmada ilk öne çıkan nokta eğitim seviyesinin yükseltilmesidir. Bu anlamda ülkelerin eğitime harcadıkları payların yükselmesi, yükseköğretim mezun sayısındaki artış ve çeşitli eğitim seferberlikleri ve projeler, bireylerin içinde buldukları yoksulluk halkasından kurtulmalarına sağlamaktadır. Bu araştırmada eğitimin yoksulluk üzerindeki etkileri çeşitli boyutlarıyla incelenmiş ve bireylerin eğitim düzeyinin yükselmesinin yoksulluğun azalmasında önemli ölçüde katkı sunduğu görülmüştür.

KAYNAKÇA

- Alpaydın, Y. (2008) "Türkiye’de Yoksulluk ve Eğitim İlişkileri", İLEM Yıllık, 3(3): 49-64.
- Esenyel, C., ve Torun, G. (2010) "Şartlı Nakit Transferi Yardım Programı: Türkiye’deki Şartlı Eğitim, Şartlı Sağlık Yardımı Uygulamaları", Uluslararası Yoksullukla Mücadele Stratejileri Sempozyumu: Deneyimler ve Yeni Fikirler, 1.
- Kalaycıoğlu, S., & Çelik, K. (2011) "Yoksulluğun Eğitim Çıktıları Üzerine Etkisi ve/ veya Düşük Eğitim Düzeylerinin Yoksulluk Üzerine Etkileri", İçinde Uluslararası Yoksullukla Mücadele Stratejileri Sempozyumu (SATA Reklam Tasarım, C. 1). Ankara: T.C. Başbakanlık Sosyal Yardımlaşma Ve Dayanışma Genel Müdürlüğü.
- Öztürk, M., ve Çetin, B. I. (2009) "Dünyada Ve Türkiye’de Yoksulluk ve Kadınlar", Journal of Yaşar University, 4(16): 2661-2698.
- Birleşmiş Milletler Genel Kurulu. (1948) “İnsan Hakları Evrensel Bildirgesi Madde 22”.
- Eurostat. (2017) “Education Statistic, Population And Social Conditions”
- OECD (2018), Poverty Rate (İndicator). Doi: 10.1787/0fe1315d-En (Accessed On 23 November 2018)
- OECD (2018), Education Spending (İndicator). Doi: 10.1787/Ca274bac-En (Accessed On 23 November 2018)

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Türkiye İstatistik Kurumu TÜİK. (2009). 2009 Yoksulluk Çalışmaları Sonuçları

Türkiye İstatistik Kurumu TÜİK. (2012). Çocuk İşgücü Araştırması

Türkiye İstatistik Kurumu TÜİK. (2017). Gelir Yaşam Koşul Araştırmaları

Türkiye İstatistik Kurumu TÜİK. (2018). İşgücü İstatistikleri

Türkiye İstatistik Kurumu (TÜİK). (2017). Eğitim Harcama İstatistikleri. Haber Bülteni

Türkiye Cumhuriyeti Cumhurbaşkanlığı. (2018). Emine Erdoğan Okuma-Yazma Seferberliği Başlattı.

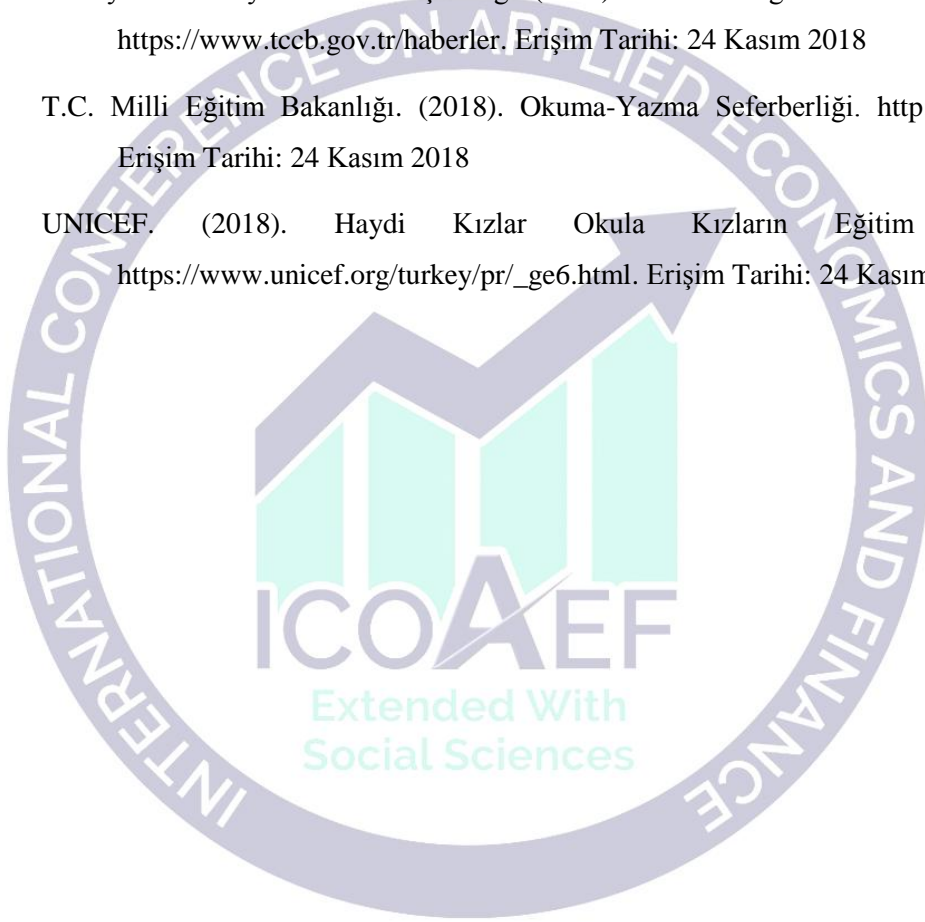
<https://www.tccb.gov.tr/haberler>. Erişim Tarihi: 24 Kasım 2018

T.C. Milli Eğitim Bakanlığı. (2018). Okuma-Yazma Seferberliği. <http://gokcebeyhem.meb.k12.tr>.

Erişim Tarihi: 24 Kasım 2018

UNICEF. (2018). Haydi Kızlar Okula Kızların Eğitim Programı 2001-2005.

https://www.unicef.org/turkey/pr/_ge6.html. Erişim Tarihi: 24 Kasım 2018



**TÜRKİYE VE RUSYA ARASINDAKİ BÖLGESEL ENERJİ İŞ BİRLİKLERİNİN BUGÜNÜ
VE GELECEĞİ**

Prof. Dr. Erdal Tanas KARAGÖL*

Araş. Görv. Esat İPEK**

ÖZET

Türkiye ve Rusya arasındaki ikili ilişkilerin en önemli boyutunu iki ülke arasındaki enerji iş birlikleri ve ticaret oluşturmaktadır. 1980'li yıllardan bugüne kadar süregelen yaklaşık 40 yıllık süre zarfında Türkiye ve Rusya arasındaki ilişki inişli çıkışlı dönemler yaşamıştır. Ancak bugün gelinen noktada iki ülkenin karşılıklı olarak gösterdikleri iyi niyet ve kararlılık sonucunda, başta enerji olmak üzere pek çok konuda beraber hareket etme fırsatı yakalanmıştır.

Türk Akım Boru Hattı ve Akkuyu Nükleer Enerji Santrali gelişen ilişkilerin somut göstergesi niteliğinde olan ve iki ülke için de stratejik önemli olan projelerdir. Akkuyu Nükleer Enerji Santrali Türkiye'yi enerji konusunda bir seviyeye taşıyarak hem arz güvenliği hem de enerjide dışa bağımlılığın sınırlandırılması açısından önemli iken Türk Akım projesi sadece Türkiye için değil aynı zamanda Avrupa ülkeleri için de enerji arz güvenliği noktasında önem taşımaktadır.

Bu çalışmada; Türkiye ve Rusya arasındaki ilişkiler özellikle enerji bağlamında değerlendirilerek, iki ülke arasındaki ilişkinin hangi süreçleri yaşayarak bugüne geldiği ve ilişkilerin geleceğinin hangi koşullarda şekilleneceği açıklanmaya çalışılmaktadır. Bu kapsamda; Türkiye, Rusya ilişkilerinin hali hazırdaki durumu, Türk Akım ve Akkuyu Nükleer projelerinin detayları, iki ülke arasındaki ilişkilerin geleceğine dair beklentiler, özellikle Hazar Denizi'ndeki belirsizliğin çözülmesiyle ortaya çıkacak fırsatlar ve Doğu Akdeniz Havzası'ndaki enerji kaynaklarının nasıl değerlendirilebileceği incelenmektedir.

Anahtar Kelimeler: *Türkiye, Rusya, Enerji, Türk Akım, Akkuyu Nükleer.*

ABSTRACT

The most important aspect of bilateral relations between Turkey and Russia constitute energy cooperation and trade between the two countries. During nearly 40 years of bumpy relations between

* Ankara Yıldırım Beyazıt Üniversitesi, Siyasal Bilgiler Fakültesi, İktisat Bölümü, Öğretim Üyesi

** Ankara Yıldırım Beyazıt Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Sosyal Politika Anabilim Dalı, Araştırma Görevlisi

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Russia and Turkey continuing until today it has experienced periods of the 1980s. However, as a result of the goodwill and determination that the two countries have mutually demonstrated, the opportunity to act together on many issues, particularly energy.

The Turkish Stream Pipeline and the Akkuyu Nuclear Power Plant are projects that are concrete indicators of the developing relations and that are strategic for both countries. Akkuyu both security of supply by moving a level on Nuclear Power Plant Turkey energy is important in terms of limiting the dependence on foreign as well as energy Turkish Stream project, not only for Turkey but also is important in terms of energy security of supply point for the European countries.

In this study; Relations between Turkey and Russia, particularly in the energy context assessed by living processes by which it came to the relationship between the two countries and the future of relations today are explained under what conditions will be shaped. In this context; Turkey, the situation in the already-Russia relations, Turkey Current and Akkuyu details of the nuclear project, expectations about the future of relations between the two countries, especially to occur with the dissolution of the uncertainty in the Caspian Sea deals and examined how to evaluate energy resources in the eastern Mediterranean Basin.

Keywords: Turkey, Russia, Energy, Flow Turkey, Akkuyu Nuclear.

1. GİRİŞ

Enerji alanında iki ülke ilişkilerinin tarihi, 1980'li yıllara dayanmaktadır. Türkiye ve Sovyetler Birliği hükümetleri arasında ilk doğalgaz anlaşması, 18 Eylül 1984 tarihinde yapılmıştır. Böylece iki ülke arasındaki ilk doğalgaz akışı, Trans Balkan Doğalgaz Boru Hattı ile Haziran 1987'de gerçekleştirilmiştir. 1998 yılında bu anlaşmaya ek olarak, 2022 yılına kadar devam edecek olan ve bahse konu miktara ilaveten sekiz milyar metreküp daha doğalgaz alımı konusunda taraflar anlaşmaya varmışlardır. Bu boru hattı üzerinden, 2003 yılına kadar Rusya'dan doğalgaz ithal edilmiştir (İsmayıl ve Aliyev, 2016).

İki ülke arasındaki enerji ilişkileri açısından Ağustos 2009 tarihi önemli bir kilometre taşıdır. Bu tarihe kadar Rus doğalgazına bağımlılığını azaltmaya çalışan Türkiye, bu görüşme sonrasında enerji alanında Rusya ile olan iş birliğini arttırmak ve ortak projeler gerçekleştirme kararı alarak hem kendisi hem de dünyanın doğusu ile batısı arasındaki enerji transferi açısından yeni bir vizyon ortaya koymuştur. Ortaya çıkan yeni vizyon, her iki ülkenin sahip olduğu güçlü irade doğrultusunda, yeni iş birliklerinin kapısını açmıştır.

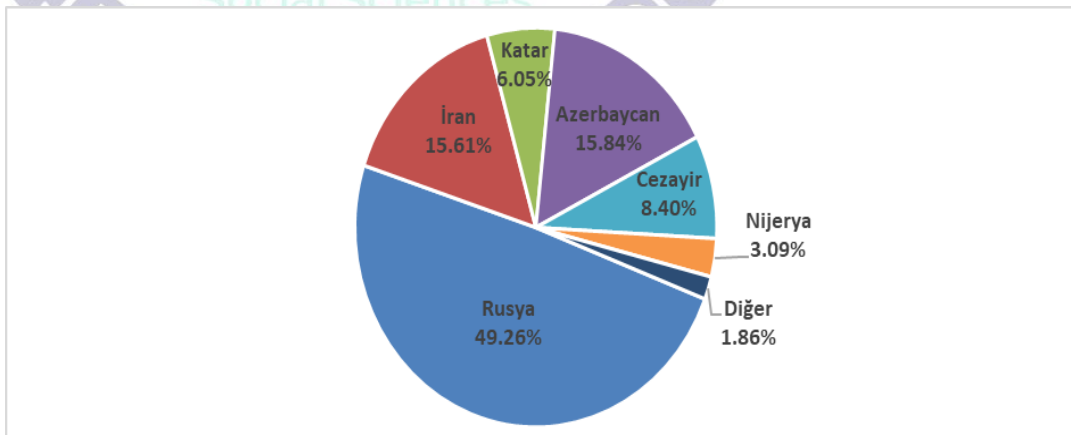
2014 yılında Türkiye ile Rusya arasındaki enerji ilişkilerinde yeni bir dönem başlamış ve ilk kez Türk Akım projesi gündeme gelmiştir. Bu projeye Rus gazının Türkiye üzerinden Avrupa'ya transfer edilebilmesinin zemini hazırlanmıştır. Bu hem Türkiye hem de Rusya ve Avrupa açısından enerji arz ve talebi konusunda yeni bir dönemin başlangıcı niteliğinde olup, Türkiye'nin "enerjide merkez ülke olma" hedefi bakımından yüksek öneme haiz bir adım niteliğindedir.

Bu çalışmada; bölgesel olarak görece daha fazla bir etki alanına ve potansiyele sahip olan Türkiye ve Rusya arasında özellikle enerji alanındaki iş birliğinin bugünü ve geleceği değerlendirilmektedir. Bu kapsamda; iki ülke arasındaki enerji ticaretinin mevcut durumu analiz edilip, hali hazırda devam etmekte olan enerji projelerinin detayları incelenecektir. Ayrıca, Türkiye ve Rusya arasındaki iş birliğinin geleceğe yönelik olarak potansiyeli ve bu iş birliğinin bölgesel ve küresel enerji ticaretini nasıl etkileyebileceği ortaya konacaktır.

2. TÜRKİYE VE RUSYA ARASINDAKİ ENERJİ İLİŞKİLERİNİN BUGÜNÜ

Türkiye ve Rusya arasında enerji alanında iş birliği hususunda en önemli başlıklar petrol, doğal gaz ve nükleer enerjidir. Petrol ve doğal gaz ticareti ise hali hazırdaki hacmi dolayısıyla bir adım daha öne çıkmaktadır. Yıllık ortalama 50 milyar metreküpün üzerinde doğal gaz tüketimi gerçekleştiren Türkiye; petrol ve doğal gazda neredeyse tamamen dışa bağımlı bir ülke konumundadır ve petrol ihtiyacının yüzde 96'sını, doğal gaz ihtiyacının ise yüzde 99'unu dışarıdan temin etmektedir (Bayraç, 2009).

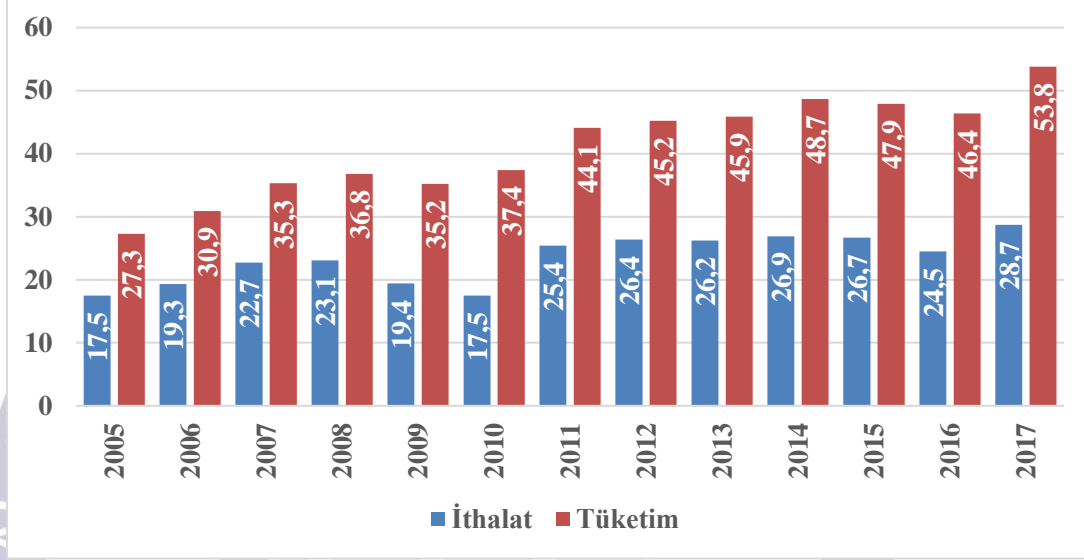
Grafik 1. Türkiye'nin İthal Ettiği Doğal Gazın Kaynak Ülkelere Göre Dağılımı (Ocak-Eylül 2018)



Kaynak: EPDK

Türkiye doğal gazdaki talebinin yaklaşık yarısını Rusya'dan karşılanmaktadır. Grafik 2 incelendiğinde 2005-2017 yılları süresince Türkiye'nin toplam yıllık doğal gaz talebi ve bu talebin ne kadarının Rusya'dan karşılandığı açıkça görülmektedir.

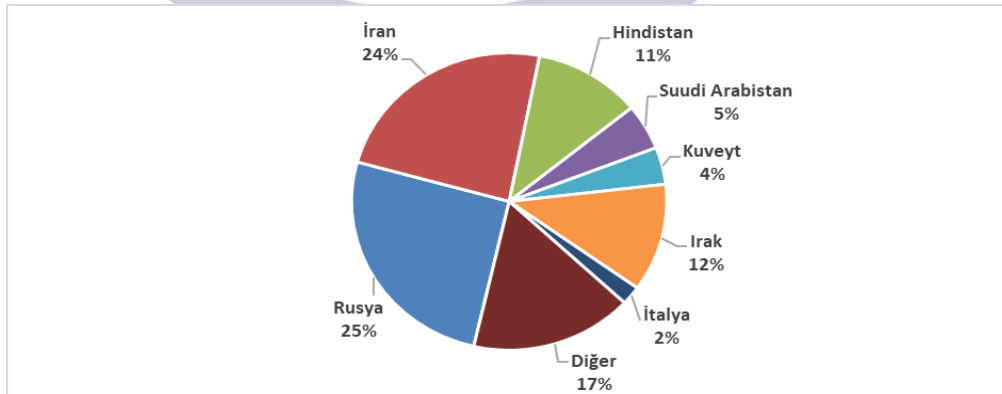
Grafik 2. Rusya'dan Yapılan Doğal Gaz İthalatı (2005-2017) (Milyar Metreküp)



Kaynak: EPDK

Diğer taraftan, Türkiye'nin yüksek oranda dışa bağımlı durumda olduğu bir diğer enerji kaynağı olan petrolde ise 2018 yılının ilk 8 aylık dönemi itibariyle yaklaşık 26 milyar ton ithalat gerçekleştirilmiştir. İthal edilen bu petrolün kaynak ülkelere göre dağılımı incelendiğinde yine Rusya'nın yüzde 25'lik bir oranla ilk sırada yer aldığı görülmektedir.

Grafik 3. Türkiye'nin İthal Ettiği Petrolün Kaynak Ülkelere Göre Dağılımı (Ocak-Ağustos 2018)



Kaynak: EPDK

Türkiye ve Rusya arasındaki enerji ilişkilerinin bugünü açısından önemli olan başka bir husus da hali hazırda devam etmekte olan enerji projeleridir. Bunlar; Rus gazının Avrupa'ya ulaştırılacak olması dolayısıyla özellikle önemli olan, Türk Akım Doğal Gaz Boru Hattı Projesi ve Türkiye açısından bir ilk olma özelliği taşıması sebebiyle yine son derece önemli olan Akkuyu Nükleer Enerji Santrali Projesi'dir.

2.1. Türk Akım Doğal Gaz Boru Hattı Projesi

Türk Akım Projesi, Rus gazının Karadeniz'in altından geçirilecek boru hatları aracılığıyla, önce Türkiye, ardından da Avrupa'ya ulaştırılması amacıyla planlanmış bir projedir. Her biri yıllık 15,75 milyar metreküp doğal gaz taşıma kapasitesine sahip iki ayrı boru hattından oluşan proje kapsamında, toplam 31,5 milyar metreküp doğal gaz transfer edilmesi planlanmıştır. İlerleyen dönemlerde ise ihtiyaca göre, projenin kapasitesinin 60 milyar metreküpün üzerine çıkabilecek şekilde genişletilmesi imkanı, teknik olarak projenin başlangıcından itibaren planlanmıştır (Furuncu, 2018).

Rus doğal gazının Türkiye aracılığıyla ilk kez Avrupa'ya ulaştırılmasını öngören bu projeye, Türkiye'nin bölgedeki enerji ticaretinde söz sahibi olan önemli ülkelerden birisi haline gelmesi kaçınılmazdır. Türkiye, bölgesinde bir enerji merkezi olma yolunda stratejiler geliştirmekte ve somut adımlar atmaktadır. Bu doğrultuda ilk kez TANAP projesi ile Hazar gazının Türkiye üzerinden Avrupa pazarlarına ulaştırılması için gerekli girişimlerde bulunulmuştur. Türk Akım kapsamında inşa edilecek ikinci kara bölümü ile de Rus menşeli doğal gazın Türkiye aracılığıyla Güneydoğu Avrupa'ya arz edilmesi sağlanacak ve Türkiye'nin doğal gaz ve petrol ticaretinde merkez ülke olma hedefine büyük bir katkı sunulmuş olacaktır (Kınık, 2009).

Türkiye'ye doğal gaz arzı sağlayacak ilk hattın ve Avrupa'ya gaz ulaşımına imkan tanıyacak ikinci hattın açık deniz kısmındaki inşaat çalışmalarında sona gelinmiştir. Bununla birlikte kara kısmındaki çalışmalar hala devam etmektedir. Her iki hattın da 2019 sonunda işletmeye alınmasıyla Türk Akım projesinin başta enerji arz güvenliği olmak üzere, siyasi dış ilişkilere kadar birçok alana etkisinin olacağı şimdiden öngörülebilmektedir.

2.2. Akkuyu Nükleer Enerji Santrali Projesi

Türkiye ile Rusya'nın son yıllarda iş birliği yaptığı bir diğer önemli konu ise nükleer enerji meselesidir. Bu alanda Rusya ile iş birliğinin ilk adımları 2010 yılında iki ülke enerji bakanlarının imzaladığı anlaşma ile atılmıştır. Bu adımın sonrasında iki ülke liderleri arasında nükleer tesis inşasına dair iş birliği yapılması yönünde bir anlaşma imzalanmıştır (Koçak, 2017).

Toplam maliyetinin 22 milyar dolar olması beklenen projenin tamamı, Rusya tarafından finanse edilecek olup, finansmanın kaynağı noktasında yap işlet devret modeli uygulanacaktır. Tamamlandığı takdirde Türkiye'nin ilk nükleer santrali olacak olan projenin yürütme yetkisi, Rusya devlet nükleer enerji şirketi olan Rosatom'a verilecektir. Projenin yüzde 51'lik kısmı proje ortaklarından Rusya'ya ait olup, yüzde 49'luk diğer kısım ise Türkiye'deki çeşitli yatırımcılar tarafından satın alınabilecektir (İsmayıl ve Aliyev, 2016).

Söz konusu nükleer santralde, her birisi 1200 megavat gücünde olan, dört reaktör kurulması planlanmıştır. Projenin tam kapasiteyle faaliyete geçtiği tarihte, Türkiye'nin yıllık elektrik ihtiyacının yüzde 10 ila 12'sinin bu santralden karşılanacağı tahmin edilmektedir. Projenin inşasının ise en erken 2022 yılında tamamlanması planlanmaktadır. Projenin ilk reaktörünün 2022 yılında üretime başlayacak olmasına rağmen, projenin tam kapasite ile çalışması 2025 yılına kadar uzayabilecektir (İsmayıl ve Aliyev, 2016).

3. TÜRKİYE VE RUSYA ARASINDAKİ ENERJİ İLİŞKİLERİNİN GELECEĞİNE DAİR BEKLENTİLER

Türkiye ve Rusya arasındaki enerji ilişkileri, mevcut durum açısından yukarıda ortaya konulan çerçevede ilerlerken, gelecek beklentileri ve yeni açılımlar bakımından önemli bir potansiyele sahiptir. Türk Akım projesi ile birlikte Türkiye ile Rusya'nın karşılıklı bağımlılık düzeyleri bugüne nazaran daha da yükselecektir. Böylece iki ülke arasındaki ilişki daha güvenli bir zemine oturmaya başlayacaktır. İki ülke arasındaki ekonomik iş birliğinin artması, her iki aktörün de aralarında meydana gelebilecek potansiyel sorunları, bu iş birliğine zarar verecek bir noktaya gelmeden, çözme yönünde politika izlemeleri sonucunu doğuracaktır.

Türkiye'nin, enerji arz güvenliğini artırma stratejisi kapsamında, kaynaklarını çeşitlendirmesi ve enerji bağımlılığını azaltması son derece önemlidir. Bu çerçevede, Türk Akım ve TANAP gibi kapsamlı projelerde yer almak, Türkiye'nin bu stratejisini hayata geçirmesine yardım edecektir. Rusya ve Azerbaycan gibi enerji zengini ülkeler ile iş birliğinin güçlendirilmesi, bölgesel ve küresel enerji denkleminde Türkiye'nin yer alması açısından, kritik bir öneme haizdir.

Türkiye'nin de aralarında bulunduğu konsorsiyumlarla, dünyanın doğusundaki enerji kaynakların Avrupa Birliği ülkeleri başta olmak üzere, dünyanın doğusuna taşınması hem Türkiye'nin hem de Avrupa Birliği'nin enerjide kaynak çeşitliliğini ve enerji arz güvenliklerini arttıracaktır. Böylece, Türkiye'nin enerjide merkez ülke olma hedefine de daha fazla yaklaşmış olacaktır. Bu noktada; iki ülke arasındaki iş birliğinin, özellikle enerji alanında son dönemde gündemde olan Hazar Denizi

kaynakları ve Doğru Akdeniz Havzası konularında da devam etmesi son derece önemlidir (Ayhan, 2009).

3.1. Hazar Denizindeki Kaynakları

Sovyet Sosyalist Cumhuriyetler Birliği'nin 1991 yılında dağılmasının ardından Hazar Denizi olarak adlandırılan bölgede birtakım statü sorunları baş göstermeye başlamıştır. Bölge üzerinde hak sahibi olan ülkeler, yakın zamana kadar bu bölgede bulunan ekonomik zenginliklerden, özellikle enerji kaynaklarından faydalanamamışlardır. Henüz yakın bir tarih olan 12 Ağustos 2018'de Hazar Denizi'nin statü sorununu çözüme kavuşturmayı amaçlayan anlaşma, bölgedeki ülkeler tarafından imzalanmıştır (Oruç, 2018).

Bölgede hak sahibi olan ülkeler; kuzeyde Rusya ve Kazakistan, güneyde İran, batıda Azerbaycan ve doğuda da Türkmenistan'dır. Bölge toplamda tahmini 50 milyar varil petrol ve 8,5 trilyon metre küp doğal gaz rezerv potansiyeli ile bütün dünyanın dikkatini çekmektedir. Bu nedenle; Hazar bölgesinde bulunan enerji kaynakları, küresel piyasalar açısından önemli bir alternatif oluşturmaktadır. Aynı zamanda, bölgede bulunan ülkelerin ekonomileri açısından da söz konusu kaynaklar büyük önem ifade etmektedir (İşcan, 2010).

Bölgede en fazla rezerve sahip olan ülke Rusya olmasına rağmen, şimdiye kadar en fazla üretimi Azerbaycan ve Kazakistan gerçekleştirmiştir. Hazar Denizinin önemi son yıllarda bölgede artan enerji projeleriyle farklı bir boyut kazanmıştır. Dolayısıyla, Hazar Bölgesi'nde bulunan petrol ve doğal gazın küresel enerji piyasalarına transfer edilmesi açısından en uygun rotalardan birisi Türkiye üzerinden geçen ve Avrupa'ya ulaşan rotadır. Hazar Denizi kaynakları bu açıdan Türkiye için de stratejik bir öneme sahiptir (Ongarova, 2017).

Türkiye ve Rusya arasında yeni enerji iş birliklerinin gündeme gelmesi kaçınılmazdır. Buradaki kaynakların, yüksek düzeyde enerji talebi olan Avrupa pazarına en az maliyetle ve en güvenilir şekilde Türkiye üzerinden transfer edilmesi -siyasi faktörler bir kenara bırakıldığında- tüm ülkeler tarafından kabul edilmektedir. Bu nedenle, Türkiye ve bölgede en fazla rezerv potansiyeline sahip ülke konumunda olan Rusya'nın enerji alanındaki ortak projelerinin artarak devam edeceği düşünülmektedir.

3.2. Doğu Akdeniz Enerji Havzası

Türkiye ve Rusya'nın enerji alanında menfaatlerinin kesiştiği bir diğer önemli bölge de Doğu Akdeniz'dir. Rusya'nın özellikle Suriye üzerindeki etkinlik alanını genişleterek Doğu Akdeniz üzerindeki varlığını sürdürme gayreti bu bölgede Türkiye ile Rusya arasında enerji alanında yeni bir iş birliğinin önünü açmaktadır.

2013 yılında Rus Soyuzneftgaz şirketi ile Suriye Petrol ve Tabii Kaynaklar Bakanlığı arasında imzalanan anlaşma neticesinde, bu bölgede petrol ve doğal gaz arama çalışmaları başlatılmıştır. Sonraki süreçte ortaya çıkan güvenlik problemlerinden dolayı sekteye uğrayan söz konusu faaliyetlerin, bölgede süregelen güvensizlik ortamının sona ermesi ve istikrarın yeniden sağlanmasıyla yeniden başlayacağı öngörülmektedir. Rusya bahse konu faaliyetler ile Suriye'ye sadece ekonomik olarak değil, aynı zamanda stratejik olarak da konuşlanmak niyetindedir.

Türkiye ise son dönemde gerek İran gerekse Rusya ile bölgede güvenliğin yeniden tesis edilmesi üzerine mesai harcamaktadır. Bölgede henüz tam anlamıyla bir istikrar ortamının sağlanamayışı buradaki kaynakların ekonomiyeye kazandırılması hususunda önemli bir engel teşkil etmektedir.

Türkiye ile Rusya'nın Doğu Akdeniz üzerindeki ortak hedefi olan enerji kaynaklarından faydalanma girişimi, ancak bölgedeki güven ortamının yeniden tesis edilmesiyle yakalanabilecektir. Bu nedenle; her iki ülkenin de buradaki önceliği, kendi çıkarları doğrultusunda bölgeye istikrar kazandırmaktır. Dolayısıyla yapılan iş birlikleri hem Türkiye'nin hem de Rusya'nın menfaatine olacaktır.

4. SONUÇ

Türkiye ile Rusya arasındaki politik ve ekonomik ilişkilerin önemli bir boyutunu enerji projeleri oluşturmaktadır. Tarihsel süreç içerisinde bu ilişkiler zaman zaman gerginliklere ve anlaşmazlıklara maruz kalsa da verimli bir seyir izlemiştir. Diğer taraftan iki ülke arasındaki ilişkiler ne kadar iyi olursa olsun bir ülkenin diğerine herhangi bir alanda bağımlılığı ulusal çıkarlar açısından tehlikeli bir durum olarak kabul edilebilir.

Türkiye özelinde değerlendirilecek olursa söz konusu ilişkiler, Türkiye'nin sürekli ve sürdürülebilir enerji temini açısından son derece önemlidir. Diğer taraftan, özellikle petrol ve doğal gazda Rusya'ya olan yüksek oranlı bağımlılık, Türkiye açısından siyasi ve ekonomik bir risk teşkil etmektedir.

Türkiye ile Rusya arasında enerji alanındaki iş birliklerinin devam etmesi gerekliliği, her iki ülkenin de farklı saiklerle olsa da sonuçta ülkelerin menfaatleri için büyük bir öneme sahiptir. Türkiye'nin alternatif enerji kaynaklarını kullanarak, yerli kaynaklarla enerji üretimini destekleyerek ve enerji ithalatında kaynak ülke çeşitliliğini artırarak, enerji arz güvenliğini sağlama noktasındaki çalışmalarına hız vermesi de özellikle Türkiye açısından stratejik öneme sahip bir başka gerekliliktir.

KAYNAKÇA

- Ayhan, V. (2009) “Avrupa'nın Enerji Arz Güvenliğinde Türkiye: Petrol, Doğal Gaz ve Entegrasyon”, Uluslararası İlişkiler Akademik Dergi. 5 (20): 155-178.
- Bayraç, H. N. (2009) “Küresel Enerji Politikaları ve Türkiye: Petrol Ve Doğal Gaz Kaynakları Açısından Bir Karşılaştırma”, Eskişehir Osmangazi Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 10(1): 115-142
- Furuncu, Y. (2018) “Enerji Güvenliği ve Karşılıklı Bağımlılık Perspektifinden Türk Akım Projesi”, SETA Vakfı. Ankara
- İsmayıl, E. ve Aliyev, B. (2016) “Türkiye Rusya İlişkilerinde Enerjinin Rolü”, TYB Akademi Dil Edebiyat ve Sosyal Bilimler Dergisi, 17: 187-201.
- İşcan, İ. H. (2010) “Uluslararası Enerji Güvenliği Açısından Hazar Bölgesi Enerji Ekonomisi ve Hazar Denizi'ni Paylaşım Sorunu”, Sosyo Ekonomi Dergisi.
- Kınık, B. (2009) “Enerji Arzı Güvenliği Açısından Avrupa Birliği-Türkiye İlişkileri”, T.C. Bahçeşehir Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Avrupa Birliği İlişkileri Yüksek Lisans Programı. Yayınlanmamış Yüksek Lisans Tezi. İstanbul
- Koçak, M. (2017) “Türkiye Rusya İlişkileri”, SETA Vakfı. Ankara
- Ongarova, Y. Kazakistan'ın Çok Yönlü Enerji Politikası ve Hazar Denizi. Alinteri Sosyal Bilimler Dergisi (ASOBİD), 2 (3): 1-21.
- Oruç, T. Ç. (2018) “Kıyıdaş Devletlerin Talepleri Çerçevesinde Hazar'ın Hukuki Statüsü ve Paylaşılması Sorunu”, Bilge İnsanlar Stratejik Araştırmalar Merkezi. Erişim Tarihi: 3 Aralık 2018.

**SOSYAL YARDIM UYGULAMALARINDA FARKINDALIK OLUŞTURULMASI VE
SOSYAL KATILIMCILIĞIN ARTTIRILMASI**

Prof. Dr. Erdal Tanas KARAGÖL*

Araş. Görv. Esat İPEK**

ÖZET

Bugün gelinen noktada Türkiye açısından mutlak yoksulluk sorunu tamamen ortadan kalkmıştır. Artık bireylerin kişisel becerilerini arttırmaya yönelik, yoksullukla ileri seviyede yapılacak bir mücadele, yani sadece temel ihtiyaçlara yönelik değil, kişisel gelişime yönelik olarak da hayata geçirilecek olan uygulamalar ön plana çıkmaktadır. Ancak bu daha bilinçli ve bilgi eksikliğinin minimum seviyeye indirildiği bir toplumda mümkün olabilecektir. Bu noktada; yoksullukla mücadelede farkındalık ve sosyal katılımçılık problemi ön plana çıkmaktadır.

Yoksullukla ileri seviyede yapılacak mücadele kapsamında bireylerin talep edecekleri sosyal yardım uygulamaları, temel ihtiyaçların karşılanmasına yönelik talep edilen sosyal yardım uygulamalarından farklı olacaktır. Bu nitelikte bir mücadelenin yürütülebilmesi için daha fazla kaynak gerekeceği muhakkaktır. Dolayısıyla, toplumun farklı kesimlerinin bu mücadeleye destek olması, yeni kaynakların bu alana aktarılabilmesini sağlayacaktır. Ayrıca, daha fazla vatandaşa ulaşılması da bu şekilde mümkün olabilecektir.

Bu kapsamda çalışmada farkındalık ve sosyal katılımçılık kavramlarının yoksullukla mücadelede benimsenen yeni anlayış çerçevesinde nasıl bir etki doğurabileceği incelenecektir. Bu kavramların dünyada ve Türkiye'de sosyal politikaların hayata geçirilmesi noktasında ve özellikle sosyal yardımların vatandaşa ulaştırılmasında nasıl kullanıldığı örneklerle açıklanacaktır. Ayrıca, yoksullukla ileri seviyede mücadele doğrultusunda, ortaya çıkacak yeni kaynak ihtiyacının yine bu kavramlar sayesinde nasıl toplumun farklı kesimleriyle ortak hareket edilerek karşılanabileceği açıklanmaya çalışılacaktır.

Anahtar Kelimeler: *Sosyal Politika, Sosyal Yardımlar, Farkındalık, Sosyal Katılımçılık.*

* Ankara Yıldırım Beyazıt Üniversitesi, Siyasal Bilgiler Fakültesi, İktisat Bölümü, Öğretim Üyesi

** Ankara Yıldırım Beyazıt Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Sosyal Politika Anabilim Dalı, Araştırma Görevlisi

**AWARENESS RAISING SOCIAL ASSISTANCE AND INCREASING SOCIAL
PARTICIPATION**

ABSTRACT

Today at the point Turkey in terms of absolute poverty has completely disappeared. There is now a struggle to increase the personal skills of individuals, a struggle with advanced level of poverty, not only for basic needs, but also for personal development. However, this will be possible in a society that is more conscious and the lack of information is minimized. At this point; In the fight against poverty, awareness and social participation problem come to the fore.

Within the scope of the struggle to be carried out at an advanced level with poverty, the social assistance applications that the individuals will demand will be different from the social assistance applications demanded to meet the basic needs. More resources will be needed to carry out a struggle of this nature. Therefore, the support of different segments of the society to this struggle will enable the transfer of new resources to this field. It will also be possible to reach more citizens.

In this context, it will be examined how awareness and social inclusion concepts can have an impact on the new understanding adopted in the fight against poverty. This concept is at the point of implementation of social policies in Turkey and the world and will be particularly described with examples of how it is used in the delivery of social benefits to citizens. In addition to this, it will be tried to explain how the need for new resources will be met in cooperation with different segments of the society by means of these concepts.

Keywords: *Social Policy, Social Benefits, Awareness, Social Participation.*

1. GİRİŞ

Sosyal yardımlar; kendi elinde olmayan nedenlerle muhtaç duruma düşen bireyleri ve grupları, insan onuruna yakışır şekilde, asgari bir yaşam seviyesine ulaştırmak için genellikle devlet, sivil toplum kuruluşları (STK'lar) ve özel sektörde sunulmaktadır. Sosyal ve ekonomik yardım uygulamalarını toplumun bahse konu kesimleri için hayata geçirmek, sosyal politika alanının öncelikli hedeflerinden birisidir. Bu çerçevede, sosyal politika, devletin; bireylerin ve dezavantajlı grupların ekonomik durumlarını, toplumun geneliyle kıyaslanabilir hale getirmek ve bireyin kişisel gelişimini ve mutluluğunu arttırmaya yönelik politikaların bütünü olarak ele alınabilir (Öksüz, 2007).

Bu noktada, sosyal yardım uygulamalarının, yoksullukla mücadelede sadece temel ihtiyaçları gidermek için var olmadığı, ayrıca bireylerin kişisel gelişimleri ve kültürel ihtiyaçları için de sosyal yardım uygulamalarının hayata geçirilmesi gerektiği görüşü ortaya çıkmaktadır. Bu, yoksullukla mücadeleyi, mutlak yoksullukla mücadelenin ötesine taşıyacak ve ileri insani gelişimi esas alacak, sosyal yardım uygulamalarının oluşturulmasını zaruri kılmaktadır. Söz konusu uygulamaların hayata geçirilmesi için devletin yanında; STK'ların, özel sektörün, meslek örgütlerinin ve vakıfların da bu konuda ellerini taşın altına koymaları gerekmektedir.

Bahse konu olan kurum ve kuruluşların sosyal yardım meselesinde daha fazla rol alabilmelerinin önündeki en büyük engellerden bir tanesi farkındalık problemidir. Sosyal politikalar alanında farkındalık kavramı; zaten var olan bir problem konusunda alakalı olan kişiler, gruplar, kurumlar ve kuruluşlar tarafından gerekli özen ve ilgilinin gösterilmesi olarak tanımlanabilir. Bu, yoksullukla ileri seviyede yapılacak bir mücadelede, devletin yükünü STK'ların, özel sektörün, meslek örgütlerinin ve vakıfların paylaşmasını sağlayacaktır.

Yoksulluğun toplum tarafından nasıl algılandığı farkındalık meselesini doğrudan etkilemektedir. Yoksulun kim olduğu, neden yoksul olduğu, toplumdaki işlevinin, yerinin ne olduğu, toplum nazarındaki yoksulluk algısını oluşturmaktadır. Yoksulluğun; tembellik, düşkünlük, bireysel hatalar, yetersizlikler üzerinden açıklanması, özellikle devlet haricindeki kesimlerin bu konuda geri durmalarına sebep olmaktadır. Yoksulluğun bu şekilde açıklanması, sosyal yardımların hedefinde olan muhtaç birey ya da grupların, acıma duygusuyla hareket edilerek, hayırseverlik temeline dayanan uygulamalarla karşı karşıya kalmalarına sebep olmaktadır. Bu da devletin maruz kaldığı yükü, toplumun diğer kesimleriyle paylaşmasına engel olmaktadır (Şener, 2010).

Diğer taraftan yoksulluğun; yapısal faktörlerle, sistematik bir şekilde açıklanması, muhtaç durumda olan bireylerin, toplumun diğer bireyleriyle eşit görülmesi, yoksullukla mücadelenin evrensel haklar temelinde ve yapısal önlemlerle yapılmasını sağlayacaktır. Bu noktada toplumun geneli üzerinde, yoksullukla ileri seviyede mücadele konusunda, bir farkındalık oluşturulması mümkün olabilecektir. Böylece devlet, muhtaç durumda olan birey ya da grupların ihtiyacı olan sosyal yardım uygulamalarını hayata geçirirken karşı karşıya kalacağı yükü; STK'lar, özel sektör, meslek örgütleri ve vakıflar gibi toplumun farklı kesimleriyle paylaşma imkanı bulacaktır.

Yukarıda bahsedilen olumsuz algının ortadan kaldırılması hem yoksulluk meselesinin ve yoksulların toplum nazarındaki itibarını yüceltecek hem de yoksullukla mücadele konusunda akıllarda oluşan makarna-kömür yardımı gibi olumsuz bir algıyı da bertaraf edecektir. Yoksullukla ileri seviyede yapılacak bir mücadele, yani sadece temel ihtiyaçlara yönelik değil, ayrıca kişisel gelişime yönelik

olarak da hayata geçirilecek olan uygulamalar ancak daha bilinçli ve bilgi eksikliğinin minimum seviyeye indirildiği bir toplumda mümkün olabilecektir. Bu noktada, farkındalık probleminin yanı sıra, sosyal katılımçılık meselesi de ön plana çıkacaktır.

2. DÜNYADA FARKINDALIK VE SOSYAL KATILIMCILIK

Farkındalık ve sosyal katılımçılık konusunda dünyadaki ülkelerin farklılaşması, temelde benimsedikleri sistemlerle ilgilidir. Farklı ülkelerin, muhtaç durumdaki yoksul vatandaşları için sundukları, genelde sosyal politika araçları özelde ise sosyal yardım uygulamalarını bireylere ve/veya gruplara nasıl ulaştırdıkları, toplumdaki hizmet sunma potansiyeline sahip kurum ve kuruluşların hem farkındalık hem de sosyal katılımçılık düzeylerini belirlemektedir. Ayrıca, ülkelerin yoksullukla mücadeleye olan bakış açıları da farkındalık ve sosyal katılımçılık açısından bir başka önemli belirleyicidir.

Benimsenen anlayış, ne kadar evrensel ilkelere ve toplumdaki her bireyi eşit gören bir sisteme dayanıyorsa, devlet haricinde yoksullukla mücadele etme potansiyeli olan özel sektör, meslek örgütleri, STK'lar ve vakıflar gibi diğer grupları da o kadar ellerini taşın altına koyma konusunda motive etmektedir. Yani, bahsi geçen bu gruplar ve kurum/kuruluşlar yoksullukla mücadele konusunda hem kendi bünyelerindeki farkındalıklarını artırma hem de toplumun geneli üzerindeki farkındalık seviyesini artırma konusunda bir azim ve motivasyona sahip olurlar. Bunun en temel nedeni de yaptıkları faaliyetlerin, toplumun geneli üzerinde gerçekten bir fayda oluşturduğu düşüncesidir.

Böylece, sosyal katılımçılık hususunda da hem toplumun daha büyük bir kesiminin sosyal yardım faaliyetlerinin sunumunda yer alması sebebiyle hizmeti sunanlar açısından hem de daha fazla muhtaç durumda olan yoksula ulaşılabilmesi sebebiyle hizmeti alanlar açısından büyük ölçüde bir artış sağlanabilecektir. Dolayısıyla, ülkelerin benimsedikleri yoksullukla mücadele anlayışı ve hizmet sunma şekli, farkındalık ve sosyal katılımçılık melesinin toplumun geneli üzerinde nasıl algılandığıyla ve toplumun bu konuya olumlu veya olumsuz nasıl reaksiyon vereceğiyle doğrudan ilgilidir. Bunu daha da ayrıntılı bir şekilde açıklayabilmek için farklı özelliklere sahip, birkaç ülkenin benimsediği, genelde sosyal politika anlayışını, özelde ise sosyal yardım uygulamalarını incelemek faydalı olacaktır.

Örneğin Almanya'da; STK'lar, kamunun sosyal yardım sistemine entegre durumdadırlar. Dolayısıyla, sosyal katılımçılık açısından oldukça avantajlı bir konumdadırlar. Kar amacı gütmeyen bu STK'lar, yerel otoritelerle iş birliği yapmış ve "korporatist ortaklık" ismi verilen ikili sistemi oluşturmuşlardır (Kaya, 2009). Karakteristik olarak Alman sisteminde, yerelde kamu statüsünde faaliyet gösteren, STK'lar sosyal yardım uygulamalarını yoksul vatandaşa ulaştırmaktadırlar. STK'lar bu hizmeti görürken, devlet tarafından belirlenen standartlara uymak zorundadırlar (Sarıkaya, 2011).

Bu, yoksullukla mücadelede sistematik bir yapının varlığına işaret etmektedir. Böylece, ülke genelindeki yoksul vatandaşa hizmet götürme kabiliyetinde olan kurum ve kuruluşlar, yaptıkları işin topluma gerçekten faydalı olduğunu düşünerek motive olmaktadır. Ayrıca, sosyal katılımçılık konusunda da yine STK'lar tarafından ülke geneline yayılmış bir sosyal içerme uygulaması mevcuttur. Özellikle çalışma hayatı açısından dezavantajlı konumda olan kadınların, daha fazla istihdam edilebilmeleri için STK'lar tarafından ülke genelinde çok sayıda kreş ve anaokulu açılmıştır. Böylece, devletin üzerinde olan büyük bir sorumluluk hem maddi olarak hem de daha yaygın hizmet sunabilmek açısından STK'lar tarafından paylaşılmıştır.

İngiltere'deki sosyal yardım uygulamaları ise ağırlıklı olarak yerel kamu hizmetleri üzerinden kurgulanmıştır. Ancak, gönüllülük esasına göre çalışan STK'lar, refah devletinin ulaşamadığı alanlarda kendilerini göstermektedirler. İngiltere'de yoksullukla mücadele alanında, merkezi ve yerel yönetimlerin iş birliği içinde yürüttüğü, ikili bir faaliyet söz konusudur (Trattner, 1998). Burada da tıpkı Almanya'da olduğu gibi STK'lar sayesinde, ayrıca yerel yönetimlerin de etkisiyle, yoksullukla mücadele konusunda, toplumun geneli üzerinde farkındalık oluşturmak için oldukça elverişli bir ortam mevcuttur.

STK'lar, kendi bünyelerinde olan ve bağlantılı oldukları gruplar sayesinde, toplumun önemli bir kesimine, bu alanda farkındalığın artırılabilmesi için ulaşabilmektedir. Ayrıca yerel yönetimler de kendi bölgelerinde hem ulaşabildikleri vatandaşları farkındalık konusunda bilinçlendirebilmekte hem de farklı ihtiyaçlara sahip grupları tespit edip rahatça ulaşabildikleri için sosyal katılımçılık manasında faydalı olabilmektedirler. Dolayısıyla, İngiltere'deki sistemin içerisinde var olan yerel yönetimler, yoksullukla mücadele konusunda hem farkındalık yaratmak için hem de sosyal katılımçılığı arttırmak için önemli bir rol üstlenmektedirler.

Finlandiya'da ise anayasa ile koruma altına alınan haklardan olan sosyal yardımlar, kendi hukuk sistemlerinde detaylıca tanımlanmıştır. Bu, yoksullukla mücadelede kullanılan sosyal yardımların, sistematik olarak halka ulaştırıldığına işaret etmektedir. Sosyal yardımlar, ülke içindeki çeşitli resmi veya gönüllü kuruluşlar tarafından, kanunların verdiği yetkiye dayanarak, halka ulaştırılmaktadır. Buradan da anlaşılacağı gibi Finlandiya'da sosyal yardımların dağıtımında STK'lar da görev almaktadır. Bahsi geçen resmi kurumlarsa, yerel kurum ve kuruluşlardır (Samele, Frew ve Urquía, 2013).

Finlandiya, muhtaç durumdaki vatandaşlarına sunduğu yardım hizmetlerinde, belirlediği standartlar açısından birçok dünya ülkesinden daha iyi bir konumdadır. Finlandiya'da üniversite dahil, eğitim-öğretimin bütün kademeleri ücretsizdir. Bu, neredeyse geri kalan bütün dünya ülkelerinde

olmayan bir uygulamadır (Pulkkinen, 2014). Eğitim konusunda toplumun en dezavantajlı gruplarından birisi olan engelliler de düşünülmüştür, çünkü mantalite olarak, eğitimde fırsat eşitliği anlayışı benimsenmiştir. Okula gidemeyen engelli çocuklar için “evde eğitim” adı verilen bir uygulama mevcuttur. Bu konuda yerel yönetimler yetkilendirilmiştir. Engelli çocuğunu evde eğitmek isteyen ebeveyn, belediye belli bir ücret karşılığında “eğitici eğitimi” aldırabilmektedir (UNESCO, 2004).

Ayrıca Finlandiya, “yaşam boyu öğrenme” felsefesini hayata geçirmiş bir ülkedir. Eğitim düzeyleri ve sosyal statüleri ne olursa olsun, tüm vatandaşlar, devletin açtığı ücretsiz kurslara katılabilmekte ve kendilerini her daim geliştirebilmektedir. Bu kurslar, halkın talepleri doğrultusunda, bölgesel farklılıklar göz önünde tutularak, belediyeler tarafından açılmaktadır. Tüm bu uygulamalardan anlaşılacağı gibi Finlandiya özellikle sosyal katılımcılık açısından, diğer ülkelere nazaran, çok daha ileri bir seviyededir. Çünkü toplumun büyük bir kesimini, sunduğu sosyal yardım uygulamaları sayesinde kapsayabilmektedir. Yoksullukla mücadele ve sosyal yardım sunma konusunda benimsediği evrensel ilkeler sayesinde, Finlandiya; farkındalık yaratma konusunda, STK’larla ve yerel yönetim birimleriyle ülke genelinde toplumun neredeyse tamamına ulaşabilmektedir.

Japon sosyal politika sistemi, ülkenin sosyo-kültürel özellikleriyle doğrudan ilişkilidir. Japonya, Almanya gibi devlet enerjisiyle hızla dönüştürülen bir toplumdur. Devlet öncülüğünde, özel sektör oluşumunun teşvikiyle, kapitalizme ayak uydurarak, Asya’daki sanayi devriminin öncüsü olmuştur. Bu ekonomik dönüşüm beraberinde; uzun ve ağır çalışma saatlerini, iş kaybetme korkusunu, gelecek kaygısını, bireysel yaşam kültürünü, yalnızlık, depresyon ve benzeri sosyal problemleri getirmiştir. İnsanlar; evlenme, aile kurma, çocuk sahibi olma gibi sorumluluklardan kaçınmakta, hatta yaşamak istemeyip, intihar etmektedirler. Bu, ülkedeki intihar girişimi sayısı göz önünde bulundurulduğunda, en büyük sosyal sorunlardan bir tanesidir.

Japon halkının, II. Dünya Savaşı’nın ardından benimsediği “çalışmak için yaşamak” felsefesi, ülkeyi kısa sürede dünya teknoloji devine dönüştürmüştür. Ancak bugün gelinen noktada, ekonomik ve sosyal sorunlar nedeniyle, bu felsefe tam tersine dönerek “yaşamak için çalışmak” halini almıştır. Japonya’daki sosyal politika uygulamaları, batı tipi çözümlerin yanı sıra, tarihten gelen, kendine has sosyo-kültürel özellikler nedeniyle, farklı sosyal sorunları ve çözümleri içinde barındırmaktadır.

Sosyal refah uygulamaları için hükümetin sahip olduğu istek ve arzuya rağmen, bütçeden ayrılan kaynağın, batı tarzı refah toplumlarıyla karşılaştırılamayacak kadar yetersiz olması, Japonya’da yeni bir modelin ortaya çıkmasına neden olmuştur. Bu modelde sosyal politikanın temeli, devlet üzerine değil; aile, cemiyet ve şirketler üzerine kurulmuştur (Bestor, 2002). Bu model, “refah devletinin” tam karşıtı olarak, “refah toplumu” şeklinde adlandırılmaktadır (Sumitaka, 1996). Sivil toplum, Japonya’daki

sosyal politika uygulamalarında çok büyük bir role sahiptir. Dolayısıyla, farkındalık yaratma ve sosyal katılımçılık konusunda Japonya, dünyadaki diğer ülkelere göre çok daha önemli kazanımlara sahiptir.

Sivil toplumun sahip olduğu farkındalık ve sosyal katılımçılık düzeyi, Japon sosyal refah sistemi içinde o kadar önemli bir yere sahiptir ki ülkenin geneline dair politikalar ve kararlar merkezi hükümet tarafından belirlenmesine rağmen, STK'ların destek vermediği kararlar, uygulama aşamasında hiçbir şekilde başarılı olamamaktadır. “Sosyal Refah Toplumu” olan Japonya’da, toplumun sahip çıktığı sosyal politikalar başarıya ulaşırken, devletin kendi başına tasarladığı ve sivil toplumdaki destek görmeyen uygulamalar, başarısızlıkla sonuçlanmaktadır.

3. TÜRKİYE’DE FARKINDALIK VE SOSYAL KATILIMCILIK

Yoksullukla mücadelede Türkiye’nin benimsemiş olduğu sistem; çerçevesi anayasayla belirlenmiş, politikaları ise Aile, Çalışma ve Sosyal Hizmetler Bakanlığı’nın, Sosyal Yardımlar Genel Müdürlüğü tarafından belirlenen ve evrensel ilkeleri temel alarak, toplumdaki muhtaç bireylerin hepsine eşit mesafede olan, modern bir sistemdir. Bu sistem, Türkiye’nin uzun yıllara dayanan tecrübeleri sonucunda, çok sayıda reformun etkisiyle, bugünkü haline gelmiştir.

Bu reformlardan en önemlisi de 2011 yılında kurulan Aile ve Sosyal Politikalar Bakanlığı’nın sosyal politikalara dair bütün sorumluluk ve yetkiyi, tek bir çatı altında toplamasıdır. 2018 yılında ise istihdama dayalı sosyal yardım uygulamaları ilkeleri doğrultusunda bakanlık yeniden teşkilatlandırılmış ve Çalışma ve Sosyal Güvenlik Bakanlığı ile birleştirilerek; Aile, Çalışma ve Sosyal Hizmetler Bakanlığı’na dönüşmüştür. Yapılan değişiklikle devletin yoksullukla ileri düzeyde mücadele etme hedefi merkeze alınmıştır.

Böylece gerek yoksullukla mücadele konusunda gerekse diğer bütün sosyal politika uygulamalarında bütüncül bir sistem benimsenmiştir. Nitekim, yapılan bu reformlar olumlu sonuçlar vermiş ve özellikle yoksullukla mücadele konusunda önemli kazanımlar elde edilmiştir. Temel ihtiyaçlardan mahrum olmak manasına gelen mutlak yoksulluk sorunu Türkiye’de çözüme kavuşturulmuş, bu noktadan sonra yoksullukla mücadele bir ileri seviyeye taşınmıştır. Artık, bireylerin beşeri sermayelerini arttırmaya yönelik ve toplumun genel sosyo-kültürel seviyesini yükseltmek için yeni adımların atılması gerekmektedir.

Bu aşmada, yoksullukla mücadelede devletin yükü daha da artacak ve farkındalık ve sosyal katılımçılık konusu daha da önem kazanacaktır. Devletin karşı karşıya kaldığı yük, yoksulluk konusuyla ilgisi olan toplumdaki diğer gruplar, kurum ve kuruluşlar tarafından paylaşılmalıdır. Yoksullukla mücadele ve yoksulluk konusunda farkındalığın artırılması; STK’ların, özel sektörün, meslek örgütlerinin ve vakıfların muhtaç durumda olan daha fazla vatandaşa ulaşılmasını sağlayacaktır. Ayrıca,

vatandaşa ulaştırılan sosyal yardım uygulamalarının hem nitelik açısından hem de nicelik açısından daha iyi bir noktaya gelmesi de sağlanacaktır.

Muhtaç durumdaki yoksul vatandaşların, ileri seviyede bir yoksullukla mücadele esnasında talep edecekleri sosyal yardım uygulamaları, temel ihtiyaçların karşılanmasına yönelik talep edilen sosyal yardım uygulamalarından farklı olacaktır. Bu yüzden, söz konusunun mücadelenin yürütülebilmesi için daha fazla kaynak gerekecektir. Toplumun farklı kesimlerinin bu mücadeleye destek olması, yeni kaynakların bu alana aktarılabilmesini sağlayacaktır. Ayrıca, daha fazla vatandaşa ulaşılması da bu şekilde mümkün olabilecektir.

Sosyal katılımcılığın artırılması da yine STK'ların, özel sektörün, meslek örgütlerinin ve vakıfların bu konuda ellerini taşın altına sokmasıyla daha ileri bir seviyeye taşınabilecektir. STK'ların, ilgi alanlarında olan spesifik grupların ihtiyaçlarını yakinen takip edebilmeleri, hayata geçirilecek olan sosyal yardım uygulamalarının, henüz ortaya çıkma aşamasında bile faydalı olabilecektir. Bu şekilde, önemli talepleri olan, ancak görece daha küçük dezavantajlı grupların sesleri, ilgili makamlara daha kolay ulaşabilecek ve sosyal katılımcılığın artırılabilmesi için önemli bir fırsat elde edilecektir.

Benzer şekilde, özel sektörün bu alana göstereceği ilgi, yoksul vatandaşların sosyal yardımlara olan bağımlılığının azaltılmasını sağlayabilecektir. Gerek özel sektör tarafından verilecek eğitimler, gerekse toplumun en dezavantajlı konumunda olan bireylere yönelik olarak hayata geçirilecek olan istihdam kampanyaları, mutlak yoksul tanımı içerisinde yer almayan, ancak halen muhtaç durumda olan vatandaşların, sosyal yardımlara duyduğu ihtiyacı ortadan kaldıracaktır. Meslek örgütleri de kendi bünyelerinde olan ve bir şekilde sosyal yardımlara ihtiyaç duyan bireylerin, sahip oldukları bilgi ve beceri seviyesini arttıracak uygulamalarla, bu kimselerin yardıma ihtiyaç duymadan, daha iyi bir hayat sürdürebilmelerinin önünü açacaklardır.

4. FARKINDALIK YARATILMASI VE SOSYAL KATILIMCILIKIN ARTTIRILMASI KONUSUNDA MEDYANIN, SİVİL TOPLUMUN VE YEREL YÖNETİMLERİN ÖNEMİ

Hali hazırda yoksullukla mücadele konusu, görece devletin sorumluluğuna bırakılmış bir durumdadır. Ancak, yukarıda da bahsedildiği gibi bu konudaki yükün sadece devletin sorumluluğuna terk edilmesi, ileri seviyede bir yoksullukla mücadele sürecinde aksaklıklara neden olabilir. Farklı grupların, bu konuda devletin yükünü paylaşması, yürütülen mücadeleyi önemli ölçüde daha etkin kılacaktır. Toplumdaki farklı grupların, bu alana daha fazla ilgi göstermelerini sağlamak için yoksullukla mücadele ve yoksulluk konusunda, toplumun geneli üzerinde farkındalık yaratılması ve sosyal katılımcılığın artırılması gerekmektedir. Bu konuda en fazla etkili olabilecek argümanların medya, sivil toplum ve yerel yönetimler başlıkları altında, detaylı bir şekilde incelenmesi faydalı olacaktır.

4.1. Medyanın Rolü

Medya, eskiden beri toplumsal farkındalık ve sosyal katılımçılık açısından her daim önemli bir etkiye sahip olmuştur. Ancak günümüzde, gelişen teknolojiyle beraber medya da bir dönüşüm geçirmiş ve bu konudaki etkisini daha da arttırmıştır. Artık her kesimden insanın; basılı, görsel ve sosyal medyayla olan ilişkisi çok daha güçlüdür. Gündelik hayatımızı yaşadığımız süreç içerisinde gördüğümüz, duyduğumuz veya okuduğumuz birçok argüman, konusu fark etmeksizin, sahip olduğumuz bilgi birikimimize yeni bir şeyler katmaktadır. Dolayısıyla, artık ilgi duyduğumuz konular hakkındaki bilişsel seviyemiz ve farkındalığımız, günlük hayatımızı yaşarken; gördüğümüz, duyduğumuz veya okuduğumuz şeylerle doğrudan ilişkili bir hal almıştır.

Günümüzde, toplumun sosyal konulardaki farkındalık seviyesi ve bu konulara olan ilgisi, medya aracılığıyla arttırılabilecek bir noktaya gelmiştir. Toplumdaki yoksulluk algısının, yapılacak mücadelede ne denli önemli olduğunu daha önceki başlıklar altında birçok kez anlatmıştık. Bu noktada, medya aracılığıyla farklı doneler kullanılarak, toplumdaki her kesim için farklı mesajlar oluşturulabilir ve doğru bir yoksulluk algısı topluma benimsetilebilir. Nitekim, mevcut durumda yoksulluk ve yoksullukla mücadele konusunda birçok yanlış düşünce toplum tarafından tartışılmaktadır. Bunların önüne geçebilmek ve doğru bir algıyı topluma yerleştirebilmek, yapılacak mücadeleyi doğrudan etkileyecektir.

Bugün gelinen noktada, medya toplumun her kesimine ulaşabilmektedir. Dolayısıyla, farkındalık yaratmaya dönük yapılacak şeylerin, topluma en çabuk ve etkili şekilde ulaştırılmasının yollarından bir tanesi medyadır. Günlük olarak yayımlanan gazetelerde ve dergilerde, yoksullukla mücadele konusunda çıkacak yazılar, basılacak çeşitli görseller ya da bir mesaj olarak halka ulaştırılacak manşetler; bu konudaki farkındalığı önemli ölçüde arttıracaktır. Ayrıca, görsel medya aracılığıyla reklamı yapılacak kampanyalar, sosyal katılımçılığın arttırılması için son derece etkili olacaktır. Son yıllarda hayatımıza iyiden iyiye giren sosyal medya aracılığıyla ise çok daha detaylı anlatımlar yapılabilecek ve özellikle genç kuşakta, yoksullukla mücadele açısından, bir farkındalık oluşturulabilecektir.

4.2. Sivil Toplumun Rolü

Sivil toplum kavramını açacak olursak, bu kavramın altına; STK'lar, meslek örgütleri, vakıflar ve özel sektör temsilcilerin yanı sıra, bireysel olarak yapılan destekler sayesinde, bireylerin de girdiğini söyleyebiliriz. Dolayısıyla sivil toplum diyerek, devletin bu konuyla ilgili kurumlarını dışarıda bıraktığımızda geriye kalan, toplumdaki bütün kurum ve kuruluşları, ayrıca bireysel olarak da bütün bireyleri kapsamış oluyoruz. Bu noktada, farkındalık yaratma ve sosyal katılımçılığın arttırılması konusunda, belki de en önemli rolün sivil topluma ait olduğunu söylemek yanlış olmayacaktır.

Sivil toplumun bu konuda sahip olduğu potansiyel ortadadır. Ancak bu potansiyelin tam manasıyla kullanılabilmesi için iki önemli ön koşul vardır. Bunlardan birincisi, sivil toplumun yoksullukla mücadele konusunda devlete duyduğu güven; ikincisi ise sivil toplumun yoksulluk sorununa olan bakış açısıdır. Bu iki ön koşul olumlu yönde tecessüm ettiği zaman, sivil toplum; devletin yoksullukla mücadelede karşı karşıya kaldığı yükü gönül rahatlığıyla paylaşacaktır. Dolayısıyla sivil toplum açısından, farkındalık yaratmak ve sosyal katılımı artırarak iki taraflı olarak işlemektedir.

Devlete bu konuda duyulan güvenin temininde ve yoksulluğa olan bakış açısının doğru bir şekilde oluşturulmasında, farkındalık problemi öne çıkarken; bu konuda STK'ların, meslek örgütlerinin, vakıfların ve özel sektörün elini taşın altına sokarak, sorumluluk üstlenmesi ve devletin yükünü paylaşması, sosyal katılım kavramını öne çıkarmaktadır. Bireylerin bu konuda inisiyatif almaları da benzer şekilde olacaktır.

Toplumun her kesiminden bu konuda destekte bulunmak isteyen bireyler, sundukları desteğin gerçekten topluma faydalı olacağı konusunda güvence hissetmelidir. Bunun için de hali hazırda yapılan uygulamalar hakkında, toplumdaki bireylerin geneli üzerinde bir farkındalık yaratılmalıdır. Bunun akabinde, sosyal katılımı artırılması konusunda, bireyler açısından önemli bir ilerlemenin sağlanması mümkün olacaktır.

Sivil toplum farkındalık yaratmak ve sosyal katılımı artırarak açısından bir diğer önemli rolü de vatandaşa ulaşma sürecinde ortaya çıkmaktadır. Bu konuda, STK'lar ilgili oldukları dezavantajlı gruplara ulaşma ve onların ihtiyaçlarını tespit etme konusunda önemli bir avantaja sahiptir. Ayrıca, hali hazırda yürürlükte olan uygulamaların duyurulması ve bunlar konusunda farkındalık oluşturulması için de büyük bir fırsata sahiptirler. Meslek örgütleri de aynı şekilde hem mevcut sosyal politika uygulamalarının duyurulması sayesinde, farkındalık yaratma konusunda hem de bünyesindeki yoksullukla mücadele potansiyeline sahip kişilerin ve kurumların harekete geçirilmesi sayesinde, sosyal katılım konusunda adımlar atabilirler.

Vakıflar da sahip oldukları kaynakları yoksullukla mücadeleye yönlendirmek için kendi bünyelerinde farkındalık yaratma çalışmaları yapabilirler ve devletin bu konudaki kaynak ihtiyacına katkı sağlayabilirler. Özel sektör ise hali hazırda kendi bünyesinde bir iş sahibi olan, ancak halen sosyal yardıma ihtiyaç duyan bireyleri hedef alan eğitim çalışmalarıyla, bu kişilerin bilgi ve beceri seviyelerini artırarak, onları sosyal yardıma ihtiyaç duymayacak bir seviyeye getirebilir. Bu konuda yapacağı farkındalık kampanyalarıyla, kurum ve kuruluşları eğitim verme konusunda teşvik edebilir.

4.3. Yerel Yönetimlerin Rolü

Yerel yönetimler, aynı ülke sınırları içinde bile olsa; coğrafi, kültürel, etnik ya da başkaca çeşitli farklılıklardan dolayı, değişik özelliklere sahip yerel halkın, devletle kuracağı ilişkide en ön sırada yer almaktadır. Sosyal alanda da yerel yönetim birimleri; devletin, vatandaşa ulaşabilmesi konusunda, önemli bir rol üstlenmektedir. Toplumdaki yoksulluk problemiyle mücadele ederken devletin üzerine düşen sorumluluğu, yerel yönetim birimleri sayesinde hafiflettiği söylenebilir. Çünkü merkezi yönetimlerin, birçok farklı ihtiyaca sahip, değişik bölgelerde yaşayan, muhtaç durumdaki bireylerin tamamına ulaşabilmesi, tespit edebilme açısından bile, mümkün değildir.

Yerel yönetimler, devletin vatandaşa en yakın birimi oldukları için gerek onların sorunlarını tespit etme açısından gerekse de onlara ulaşabilme açısından büyük bir fırsata sahiptirler. Sosyal politikalar konusunda, özellikle de yoksullukla mücadele konusunda, vatandaş üzerinde farkındalık yaratmak ve sosyal katılımı arttırmak için yerel yönetim birimleri, merkezi yönetimlere göre daha avantajlı bir konuma sahiptirler. Yerel halka olan yakınlıkları onlara bu avantajı sağlamaktadır. Vatandaşla daha kolay ve hızlı iletişim kurabilmeleri, hayata geçirilmek istenen sosyal uygulamaların, onlara daha etkili bir şekilde anlatılmasını sağlayacaktır. Dolayısıyla, farkındalık yaratma konusunda etkili adımlar atabileceklerdir.

Ayrıca, yerel halkın kendine özgü sosyal sorunlarını yerinde tespit edip, müdahale etme şansına sahip oldukları için yerel yönetimler, sosyal katılımı artırılması konusunda da etkili olabileceklerdir. Bu noktada hem dezavantajlı gruplara ve/veya bireylere ulaşma açısından hem de yoksullukla mücadelede devlete destek olma potansiyeli olan yerel kurumları ve/veya bireyleri bu konuda sorumluluk almaya yönlendirme açısından sosyal katılımı artırılmasını sağlayabileceklerdir.

Yerel yönetimler her ne kadar devletin yoksullukla mücadele konusunda karşı karşıya kaldığı yükü doğrudan hafifletemese de özellikle kaynak aktarma konusunda faydalı olabilirler. Çünkü en nihayetinde yerel yönetim birimleri de devletin bir parçasıdır. Yerel halk arasından maddi açıdan durumu elverişli olan bireylerin veya kurumların, hayata geçirilecek bağış kampanyaları sayesinde sağlayacakları maddi destekler, yoksullukla mücadele konusunda devletin yanında toplumdaki diğer grupların da ellerini taşın altına sokmalarını sağlayacaktır. Bu noktada da farkındalığın ve sosyal katılımı ön plana çıktığı görülmektedir. Yerel yönetimler doğrudan temas halinde oldukları yerel halkı bu konularda bilinçlendirebilir ve çeşitli yönlendirmelerle onları harekete geçirebilirler.

Yerel yönetim birimleri bünyesinde yürütülecek kampanyalar, düzenlenecek eğitimler veya oluşturulacak yoksullukla mücadele araçları; merkezi idarelerin yapacaklarından daha hızlı ve etkili bir

şekilde yerel halka ulaşabilir. Ayrıca hem farkındalık yaratma konusunda hem de sosyal katılımı artırma konusunda, farklı algı düzeylerine sahip grup veya bireylerin, ne şekilde motive edilebileceğini yerel idari birimler, merkezi yönetimlere göre daha kolay belirleyebilirler. Böylece yoksullukla mücadele konusunda, devlet tarafından vatandaşa ulaştırılmak istenen mesajlar, farklı yollarla da olsa daha çok kişiye ulaştırılabilecektir. Bu hem farkındalık yaratma konusunda hem de sosyal katılımı artırma konusunda, yerel birimlerin sahip olduğu rolü açıkça göstermektedir.

5. SONUÇ

Son yıllarda özellikle yoksullukla mücadelede belirli bir aşamaya gelinmesi hasebiyle, bu konuda farklı bir yürütülen çalışmaların farklı bir niteliğe bürünmesi fikri ortaya çıkmıştır. Bu, yoksullukla mücadele artı, ileri seviyede yoksullukla mücadele ya da yoksullukla mücadelede ileri insani gelişmişlik gibi farklı şekillerde ifade edilen yeni bir yaklaşımı ortaya koymaktadır. Bu noktada, sosyal yardım uygulamalarının; yoksullukla mücadelede sadece temel ihtiyaçları gidermek için var olmadığı, bireylerin kişisel gelişimleri ve kültürel ihtiyaçları için de sosyal yardım uygulamalarının hayata geçirilmesi gerektiği görüşü ortaya çıkmaktadır. Bu kapsamda hayata geçirilecek uygulamaların oluşturacağı sorumluluk ve yük, devletin yanında STK'ların, özel sektörün, meslek örgütlerinin ve vakıfların da bu paydaş olmalarını zaruri kılacak boyuttadır.

Devletin yükünü ve sorumluluğunu paylaşması beklenen; STK'ların, özel sektörün, meslek örgütlerinin ve vakıfların sosyal yardım meselesinde daha fazla rol alabilmelerinin önündeki en büyük engellerden bir tanesi farkındalık problemidir. Toplumda hali hazırda var olan yoksulluk algısı; yoksulun kim olduğu, neden yoksul olduğu, toplumdaki işlevinin, yerinin ne olduğu ile ilgilidir. Yoksulluğun; tembellik, düşkünlük, bireysel hatalar, yetersizlikler üzerinden açıklanması, özellikle devlet haricindeki kesimlerin bu konuda geri durmalarına sebep olmaktadır.

Diğer taraftan, yoksulluğun; yapısal faktörlerle, sistematik bir şekilde açıklanması, muhtaç durumda olan bireylerin, toplumun diğer bireyleriyle eşit görülmesi, yoksullukla mücadelenin evrensel haklar temelinde ve yapısal önlemlerle yapılmasını sağlayacaktır. Bu sayede devlet de muhtaç durumda olan bireyler için yapacağı mücadelede STK'lar, özel sektör, meslek örgütleri ve vakıflar gibi toplumun farklı kesimleriyle paydaş olarak hareket edebilecektir.

Yoksullukla mücadelede benimsenen anlayış, evrensel ilkelere ve toplumdaki her bireyi eşit gören bir sisteme dayandığı ölçüde, devlet haricindeki kurum ve kuruluşların desteğini alacaktır. Toplumun farklı kesimlerini temsil eden bu yapılar, sahip oldukları imkanı kullanırken herhangi bir çekince ya da dezenformasyon yaşamayacaklardır. Bu motivasyonun en temel nedeni de yaptıkları faaliyetlerin, toplumun geneli üzerinde gerçekten bir fayda oluşturabileceği düşüncesidir.

KAYNAKÇA

- Bestor, V. L. (2002) "Toward a Cultural Biography of Civil Society in Japan. R. Goodman (Ed.), Family and Social Policy in Japan", Cambridge University Press.
- Kaya, E. (2009) "Yoksullukla Mücadelede Avrupa'nın ve Türkiye'nin Sosyal Yardım Modeli" (Sosyal Yardım Uzmanlık Tezi). T.C. Başbakanlık Sosyal Yardımlaşma ve Dayanışma Genel Müdürlüğü, Ankara.
- Öksüz, Ö. (2007) "Yerel Yönetimlerimizin Çoğu, Alt Yapı Açısından Yerel Sosyal Politikalar Uygulamaya Hazır ve Müsait Değil", Sosyal Politikalar Dergisi, 2: 88-90.
- UNESCO. (2004) "The Development of Education: National Report of Finland" (National Report). Finland: The National Board of Education.
- Ülker, Ş. (2010) "Yoksullukla Mücadelede Sosyal Güvenlik, Sosyal Yardım Mekanizmaları ve İş Gücü Politikaları", TEPAV, Ankara
- Pulkkinen, E. (2014) "Country Sheet on Youth Policy in Finland", European Union and Council of Europe.
- Sarıkaya, M. (2011) "Sosyal Hizmet Kurumlarında Yönetim" (1. Baskı). Ankara: Nobel Yayın Dağıtım.
- Samele, C., Frew, S., and Urquía, N. (2013) "Mental Health Systems in the European Union Member States, Status of Mental Health in Populations and Benefits to be Expected from Investments into Mental Health", The Institute of Mental Health.
- Sumitaka, H. (1996) "The Aging Society, The Family and Social Policy", Institute of Social Science, University of Tokyo.
- Trattner, W. I. (1998) "From Poor Law to Welfare State: A History of Social Welfare in America" (6 Sub edition). New York: Free Press.

FESTİVALLERİN ETKİLERİNE YÖNELİK ÇALIŞMALARIN İNCELENMESİ

Eylin AKTAŞ*

Seher CEYLAN**

Nuray Selma ÖZDİPÇİNER***

ÖZET

Festivaller genellikle gerçekleştirildiği destinasyona özgü kültürel kutlamalar ve sanat etkinlikleri çerçevesinde karşımıza çıkan özel etkinliklerdir. Festivallerin yarattığı ekonomik, sosyal, kültürel, çevresel, bireysel ve mekânsal etkilerinden söz edilebilmektedir. Bu çalışmanın amacı, uluslararası ve ulusal alanda festivallerin yarattığı ekonomik, sosyal, kültürel, çevresel, bireysel ve mekansal etkilere yönelik yayınlanmış çalışmaları analiz etmektir. Bu amaç doğrultusunda veri tabanları aracılığıyla festivallerin etkileri ile ilgili yayınlanmış 113 uluslararası ve 20 ulusal makaleye ulaşılmıştır. Makaleler yayın yılı, yayınlanan dergi, incelenen etki türü/türleri, incelenen festivalin türü/türleri, festivalin gerçekleştirildiği ülke, makalede kullanılan yöntem (yaklaşım, veri toplama yöntemi ve örneklem) çerçevesinde değerlendirilmiştir. Bulgular uluslararası makalelerde yoğun olarak çalışılan ekonomik etkiler ile ilgili çalışmaların son yıllarda azaldığını ve diğer etki türlerine yönelik çalışmaların arttığını, uluslararası makalelerde nicel yaklaşımın daha çok kullanıldığını, yerel festivallere ve sanat festivallerine yönelik çalışmaların birbirine yakın oranlarda olduğunu göstermektedir. Ulusal makaleler ise festivallerin etkilerine yönelik çalışmalarda hem nicelik hem de nitelik olarak yetersiz kalmaktadır.

Anahtar Kelimeler: *Etkinlik, Festival, Festivallerin Etkileri.*

JEL Kodları: *G14, Z32, R10.*

ANALYSIS OF STUDIES ABOUT THE IMPACTS OF FESTIVALS

ABSTRACT

Festivals are special events we generally encounter within the frame of destination-specific cultural celebrations and art events. Festivals have economic, social, cultural, environmental, personal and place impacts to host community and destination. The purpose of the study is to analyze published

* Pamukkale Üniversitesi, İletişim Fakültesi, Denizli, eabacan@pau.edu.tr

** Pamukkale Üniversitesi, Sosyal Bilimler Meslek Yüksekokulu, Denizli, ceyslans@pau.edu.tr

*** Pamukkale Üniversitesi, Turizm Fakültesi, Denizli, nselma@pau.edu.tr

studies about economic, social, cultural, environmental, personal and place impacts of festivals. For this purpose, 113 international and 20 national articles on the impacts of festivals have been reached through databases. Articles were evaluated in the framework of publication year, published journal, type/types of festival impact, type/types of festival studied, country where the festival hosted, method used in the article (approach, data collection method and sample). The findings show that studies on the economic impacts studied in international articles have decreased in recent years, and studies on other types of impacts have increased, and that the quantitative approach is more used in international articles, and studies on local festivals and arts festivals are close to each other. National articles are insufficient both in terms of quality and quantity in the studies on the impacts of festivals.

Anahtar Kelimeler: *Event, Festival, Impacts of Festivals.*

JEL Codes: *G14, Z32, R10.*

1.GİRİŞ

Festival kelimesi, ‘kutlama zamanı’ anlamına gelen ‘feast’ kelimesinden türetilmiştir. Festival, “kamusal ve temalı kutlama” olarak tanımlanmaktadır (Getz, 1997:8). Festivallerin temel özellikleri arasında; özellikle yerel kültüre ilişkin etkinliklerde otantiklik ve özgünlük, konukseverlik ve ulaşılabilirlik, katılımcılar ve izleyiciler için temalandırma ve sembolik unsurların kullanımı (Derrett, 2004:32) sayılabilmektedir.

Festivallerin etkilerine yönelik literatür incelendiğinde festivallerin ekonomik, sosyal, kültürel, çevresel, mekânsal ve bireysel etkilerine yönelik çalışmaların yoğunlaştığı görülmektedir.

Festivallerin **ekonomik etkilerine** yönelik çalışmalarda; turist harcamaları (örn. Long ve Perdue, 1990; Crompton, Lee ve Shuster, 2001; Tang ve Turco, 2001; Brown, Var ve Lee, 2002; Rao, 2001; Lee ve Crompton, 2003, Kruger, Saayman ve Ellis, 2010; Saayman ve Rossouw, 2010, 2011; Andersson ve Lundberg, 2013; Shuib, Edman ve Yaakub, 2013), çarpan etkisi (örn. Saayman ve Rossouw, 2011), ekonomik ve bölgesel kalkınmaya katkı (örn. Felsenstein ve Fleischer, 2003), vergi gelirleri (örn. Turco, 1995; Tohmo, 2005), istihdam (örn. Tohmo, 2005), yeni iş alanlarının oluşması (örn. Mitchell ve Wall, 1989), turizm hareketliliği, varlıklar ve konaklama etkisi (örn. Nurse, 2004; Litvin ve Fetter, 2006; Branna ve Nordstrom, 2006), etkinlik bütçesi ve harcamaları (örn. Saayman ve Rossouw, 2010; Bracalente v.d., 2011), uluslararasılaşma (örn. Rivera, Semrad ve Croes, 2015), yerel ticaret (örn. O’Sullivan ve Jackson, 2002) ve ekonomik maliyetler (örn. Han v.d., 2017) gibi etkiler üzerinde durulmaktadır.

Festivallerin *sosyal ve kültürel etkileri* ile ilgili çalışmalarda toplumsal kimlik ve uyum (örn. De Bres ve Davis, 2001; Fredline, Jago ve Deery, 2003; Kim ve Uysal, 2003; Gürsoy, Kim ve Uysal, 2004; Crespi-Vallbona ve Richards, 2007; Small, 2007; Yolal, Çetinel ve Uysal, 2009), toplumsal bağlılık (örn. Derrett, 2003; Fredline, Jago ve Deery, 2003; Attanasi v.d., 2013), topluluk imajı, (örn. Yolal v.d., 2016), kültürel miras ve yerel kültür (örn. Xiao ve Smith, 2004), sanatsal gelişme (örn. Quinn, 2006), yerel katılım (örn. Quinn, 2006), yaşam standartı (örn. Chen, 2011), sosyal ve kültürel değişim (örn. Xiao ve Smith, 2004; Sharpe, 2008), sosyal ve kültürel sermaye (örn. Yuen ve Glover, 2005; Gonzalez ve Miralbell, 2011; Attanasi v.d., 2013), kalabalık, güvenlik, suç oranları, sosyal hizmetler üzerindeki baskı gibi sosyal maliyetler (örn. Kim ve Uysal, 2003; Gürsoy, Kim ve Uysal, 2004; Yolal, Çetinel ve Uysal, 2009; Yolal v.d., 2015; Han v.d., 2017) gibi unsurlar üzerinde durulmaktadır.

Festivallerin *çevresel etkilerine* bakıldığında hava kirliliği (örn. Zuoping ve Jianxue, 1995; Thakur v.d., 2010; Chang v.d., 2011; Huang, v.d., 2012), atık (örn. Refiee v.d, 2018), gürültü ve trafik sorunları (Getz, 2010), sürdürülebilirlik (örn. Mair ve Laing, 2012), ekolojik ayak izi (örn. Andersson ve Lundberg, 2013; Andersson, Jutbring ve Lundberg, 2013) ve çevre ile ilgili tutum ve davranış etkisi (örn. Marks, Chandler ve Baldwin, 2016) gibi etkilerin incelendiği görülmektedir.

Festivallerin *bireysel etkileri* arasında katılımcıların memnuniyeti, davranışları ve festivallere katılım nedenleri (Gül, Erdem ve Gül, 2013), sağlık ve iyi oluşluluk (örn. Packer ve Ballantyne, 2011; Yolal v.d., 2016), eğitim ve tutum değişimi (Getz, 2010), alkol ve uyuşturucu kullanımı (Lim, v.d., 2008) gibi etkiler tartışılırken, *mekânsal etkileri* arasında ise destinasyon imajı ve markalaşma (örn. Hede ve Jago, 2005; Wood, 2005; Cudny, Korec ve Rouba, 2012; Yemenoğlu vd. 2013; Özgürel, Alan ve Bingöl, 2015; Özkan, Curkan ve Sarak, 2015; Cizmic ve Causevic, 2017), destinasyona ilişkin alt ve üst yapı gelişimi (Getz, 2010) gibi etkiler incelenmektedir.

Görüldüğü gibi festivallerin ekonomik, sosyal, kültürel, çevresel, bireysel ve mekânsal etkilerine yönelik çok sayıda çalışma yürütülmüş ve bu etkiler çeşitli açılardan incelenmiştir. Getz (2010) festivallere yönelik yürütülmüş çalışmalarını incelemiş ve festival çalışmalarının ana hatlarını ortaya koymuştur. Ancak festivallerin etkilerine özel olarak yürütülmüş ve yapılan araştırmaların incelendiği bir çalışmaya rastlanmamıştır. Bu doğrultuda bu çalışma ile festivallere yönelik yürütülen etki araştırmalarını analiz etmek amaçlanmaktadır.

2.YÖNTEM

Çalışmanın amacı, uluslararası ve ulusal düzeyde festivallerin yarattığı ekonomik, sosyal, kültürel, çevresel, bireysel ve mekansal etkilere yönelik yayınlanmış çalışmalarını analiz etmektir. Bu amaç doğrultusunda festivallerin etkileri ile ilgili yayınlanmış çalışmalara ulaşılmaya çalışılmış ve

bunun için veri tabanları ve ulaşılan çalışmaların kaynaklarından yararlanılmıştır. Çeşitli veri tabanlarında “festival”, “impact”, “effect” gibi kelimeler ile tarama yapılmış, festivallerin yarattığı etkiler ile ilgili olan çalışmalar ayrılmıştır. İncelemeye dahil edilen çalışmaların belirlenmesinde aşağıdaki kriterler dikkate alınmıştır:

Sadece yayınlanmış makaleler temel alınmıştır. Kitap, kitap bölümü, bildiri, tez gibi çalışmalar inceleme alanı dışında bırakılmıştır.

Bir festival örneği/türü çerçevesinde inceleme yapılmış ve festivallerin etkileriyle ilgili yürütülmüş ampirik çalışmaları içeren makaleler değerlendirmeye alınmıştır. Derleme, literatür analizi gibi makaleler incelemeye dahil edilmemiştir.

Sadece tam metnine ulaşılabilen makaleler değerlendirmeye alınmıştır.

Bu tarama sonucunda 113 uluslararası ve 20 ulusal makale tespit edilmiştir. Belirlenen makaleler yayın yılı, makalenin yayımlandığı dergi, makalede incelenen etki türü/türleri, makalede incelenen festival türü/türleri, makalede incelenen festivalin gerçekleştiği destinasyon (ülke), makalede kullanılan yöntem (yaklaşım, veri toplama yöntemi, örneklem) kriterleri çerçevesinde incelenmiştir.

3.BULGULAR

Bulgular bölümü uluslararası ve ulusal makaleler ile ilgili bulgular olmak üzere iki bölümde incelenmektedir.

3.1.Uluslararası Makaleler ile İlgili Bulgular

İncelenen 113 makalenin 7'si belirli bir örnek festival incelemeksizin festivallerin etkileriyle ilgili ampirik çalışmaları içermektedir. Bu çalışmalar, festival ile ilgili kişi ve kurumlar ve yerel halka yönelik yürütülmüş çalışmalardır. 106'sında ise makale içinde adı geçen veya makale içinde adı geçmese de türü ve gerçekleştiği destinasyon belirtilmiş en az bir festival örneği çerçevesinde etki araştırması yapılmaktadır.

Tablo 1. Yıllara ve İncelenen Etki Türüne Göre Makalelerin Dağılımı

| Yıl Aralıkları | Makale Sayısı | Etki Türü | Makale Sayısı |
|----------------|---------------|-----------|---------------|
| 1985-2000 | 12 | Ekonomik | 9 |
| | | Sosyal | 3 |
| | | Çevresel | 1 |
| | | Kültürel | 1 |
| 2001-2010 | 60 | Ekonomik | 36 |
| | | Sosyal | 22 |
| | | Kültürel | 13 |
| | | Çevresel | 3 |
| | | Bireysel | 3 |
| | | Mekansal | 8 |
| 2011-2018 | 41 | Ekonomik | 18 |
| | | Çevresel | 8 |
| | | Sosyal | 19 |
| | | Kültürel | 8 |
| | | Çevresel | 6 |
| | | Bireysel | 7 |
| | | Mekansal | 2 |

İncelenen makalelerin yıllara ve etki türüne göre dağılımı Tablo 1’de görülmektedir. Tablo incelendiğinde festivallerin etkileri ile ilgili makalelerin 2000 yılından sonra belirgin bir biçimde arttığı görülmektedir. Diğer taraftan makalelerde incelenen etki türleri ekonomik (63 makale), sosyal (44 makale), kültürel (22 makale), çevresel (18 makale), bireysel (10 makale) ve mekânsal (10 makale) etkilerdir. Kimi çalışmalarda bir etki türü, kimilerinde ise iki ve daha fazla etki türü birlikte incelenmektedir. Bu doğrultuda incelenen etki türleri tek tek değerlendirmeye alınmıştır. Bu doğrultuda ekonomik etkiler ile ilgili çalışmalar 1985-2010 zaman aralığında çok yoğunken, 2011-2018 döneminde azalmakta ve sosyal etkiler ile çevresel ve bireysel etkilere yönelik çalışmaların sayısı artmaktadır.

Tablo 2. Yayınlandıkları Dergilere Göre Makalelerin Dağılımı

| Dergi Adı | Makale Sayısı |
|--|----------------------|
| Event Management | 14 |
| Tourism Economics | 9 |
| Tourism Management | 6 |
| Journal of Travel Research | 5 |
| International Journal of Event and Festival Management | 5 |
| Journal of Sustainable Tourism | 5 |
| Journal of Convention & Event Tourism | 5 |
| Festival Management and Event Tourism | 3 |
| International Journal of Event Management Research | 3 |
| Managing Leisure | 3 |
| Journal of Park and Recreation Administration | 2 |
| Journal of Vacation Marketing | 2 |
| Leisure Sciences | 2 |
| International Journal of Cultural Policy | 2 |
| Annals of Tourism Research | 2 |
| Diğer | 44 |

Yukarıda yer alan Tablo 2 incelenen makalelerin yayınlandıkları dergilere göre dağılımını göstermektedir. Etkinlik çalışmalarının çok disiplinli yapısı makalelerin yayınlandığı dergilere de yansımaktadır. Tablo incelendiğinde Event Management, Tourism Economics, Tourism Management gibi dergilerde festivallerin etkilerine yönelik makalelerin daha yoğun olarak yayınlandığı görülmektedir. Ancak tabloda yayınlanan makale sayıları belirtilen dergiler dışındaki diğer dergiler incelendiğinde turizm (11 dergi), bölgesel gelişme (9 dergi), çevre (8 dergi), sosyoloji/kültür (4 dergi), sanat (4 dergi), coğrafya (4 dergi), işletme-yönetim (4 dergi) gibi alanlarda çok sayıda dergide festivallerin etkileri ile ilgili çalışmaların yayımlanabildiği görülmektedir.

Tablo 3. Yıllara, Festival Türüne ve İncelenen Festivalin Gerçekleştiği Destinasyona/Ülkeye Göre Makalelerin Dağılımı

| Etkinlik Türü | 1985-2000 | 2001-2010 | 2011-2018 |
|-----------------------------|------------------|------------------|------------------|
| Yerel festivaller | 9 | 48 | 32 |
| Sanat Festivalleri | 7 | 40 | 39 |
| Diğer | - | 3 | - |
| Sanat Festivali Türü | 1985-2000 | 2001-2010 | 2011-2018 |
| Müzik | 3 | 18 | 27 |
| Tiyatro | 2 | 2 | |
| Karma | 2 | 18 | 6 |
| Film | | 2 | 5 |
| Ülke | 1985-2000 | 2001-2010 | 2011-2018 |
| ABD | 12 | 27 | 2 |
| Avustralya | - | 13 | 11 |
| İngiltere | 1 | 15 | 11 |
| Kanada | 2 | 10 | - |
| Çin | 1 | 1 | 14 |
| Güney Afrika | - | 7 | 2 |
| Türkiye | - | 1 | 6 |

Tablo 3, incelenen makalelerde hangi festival türü üzerine çalışıldığını göstermektedir. Getz'in (1997) sınıflandırmasına göre festivaller kültürel kutlamalar içerisinde yer alan yerel etkinliklerdir. Ancak makalelere bakıldığında sanat festivallerinin de önemli oranda incelemeye tabi tutulduğu görülmektedir. Bu doğrultuda makalelerde incelenen festivaller yerel festivaller ve sanat festivalleri olmak üzere iki gruba ayrılarak değerlendirilmiştir. Makalelerde toplam 178 festival incelenmiştir (kimi makalelerde bir kimilerinde ise birden fazla festival incelenmektedir). Bu festivallerin 89'u yerel festival ve 86'sı sanat festivali, 3'ü ise diğer festivallerdir (ışık festivali, kitap festivali, alışveriş festivali). Yıllara göre bakıldığında incelenen festival türünde belirgin bir değişim görülmemektedir. Diğer taraftan sanat festivalleri içerisinde müzik (48 makale) ve karma sanat (26 makale) festivalleri ağırlıklı olarak incelenmiştir. Müzik festivallerine yönelik etki incelemeleri yıllar içerisinde artmaya devam etmekte, ancak karma sanat festivalleri ile ilgili çalışmaların sayısı azalmaktadır. Bunun yanında film festivalleri 2011-2018 yıllarını kapsayan dönemde etkileri incelenmeye başlanan bir festival türü olarak ortaya çıkmaktadır.

Makalelerde incelenen festivalin hangi ülkede gerçekleştiğine bakıldığında ABD (41 festival), İngiltere (27 festival), Avustralya (24 festival), Çin (16 festival), Kanada (12 festival) gibi ülkelerde gerçekleşen festivaller ile ilgili çalışmaların diğerlerinden belirgin bir biçimde farklılaştığı görülmektedir. Diğer taraftan yıllar itibariyle incelendiğinde önceki yıllarda yoğun olarak çalışılan ABD festivalleri 2011-2018 yılları arasında önemli oranda düşmekte, Avustralya, İngiltere ve Çin'de gerçekleşen festivallere yönelik makalelerin sayısı ise artmaktadır.

Tablo 4. Kullanılan Yöntem ve İncelenen Etki Türüne Göre Makalelerin Dağılımı

| | Nicel | Nitel | Nitel + Nicel | İkincil kaynak (raporlar, kayıtlar, istatistikler vb.) | Çevresel ölçümler |
|----------|-------|-------|---------------|--|-------------------|
| Ekonomik | 47 | 1 | 2 | 9 | |
| Sosyal | 31 | 4 | 2 | | |
| Kültürel | 14 | 7 | | 1 | |
| Çevresel | 6 | 3 | 2 | | 6 |
| Bireysel | 7 | | 3 | | |
| Mekansal | 6 | | 2 | 2 | |

Genel olarak makalelerde nicel yaklaşımın (72 makale) benimsendiği görülmektedir. Nitel yöntemin kullanıldığı makale sayısı 15 iken, nitel ve nicel yöntemlerin birlikte kullanıldığı makale sayısı 7'dir. Ayrıca makalelerde ikincil kaynaklardan da yararlanılmıştır. Genellikle festival dönemlerindeki istatistiklerin (turist varışları, konaklama oranları, vergi istatistikleri vb.) incelenmesi yoluyla gerçekleştirilen ikincil kaynak çalışmalarının sayısı ise 13'tür. Bunların dışında festivallerin çevresel etkilerini görebilmek amacıyla kirlilik, atık ölçümü gibi yöntemler de (6 makale) makalelerde kullanılmaktadır.

Nicel ve nitel-nicel yöntemin birlikte kullanıldığı makalelerde anket ile veri toplanırken (80 makale), nitel ve nitel-nicel yöntemin benimsendiği çalışmalarda görüşme (19 makale), gözlem (4 makale) ve fokus grup (3 makale) tekniklerinden yararlanılmıştır. Etki türüne göre incelendiğinde ekonomik etkilerin incelendiği çalışmalarda nicel yaklaşım ve ikincil kaynaklardan yararlanılırken, sosyal ve kültürel çalışmalarda nicel ağırlıklı olmak üzere nitel yöntemlerden de yararlanılmaktadır.

Makaleler çalışılan örneklem türü bakımından da incelenmiştir. Makalelerde genel olarak ziyaretçiler (33 makale), yerel halk (23 makale), katılımcılar (21 makale), etkinlik ile ilgili kişi ve kurumlar (18 makale), yerel işletmeler (4 makale), izleyiciler (2 makale) ve uzmanlar, sponsorlar, sivil toplum örgütleri, kamu kurumlarından oluşan diğer (5 makale) gruplara yönelik araştırmalar yürütülmüştür.

Tablo 5. Örneklem Türü ve İncelenen Etki Türüne Göre Makalelerin Dağılımı

| | Ziyaretçiler | Yerel Halk | Katılımcılar | Festivale ilgili kişi ve kurumlar | Yerel işletmeler |
|----------|--------------|------------|--------------|-----------------------------------|------------------|
| Ekonomik | 28 | 9 | 9 | 7 | 4 |
| Sosyal | 2 | 19 | 9 | 11 | 2 |
| Kültürel | | 11 | 4 | 4 | |
| Çevresel | 1 | 6 | | 3 | |
| Bireysel | 2 | 4 | 4 | | |
| Mekansal | 2 | 2 | 3 | 1 | 1 |

İncelenen etki türüne göre örneklem seçimine yönelik bulgular Tablo 5'te görülmektedir. Genellikle ekonomik etkilerin incelendiği çalışmalarda ziyaretçiler (28 makale) örneklem olarak seçilirken, sosyal ve kültürel etkilerin araştırıldığı çalışmalarda yerel halk (sosyal etkiler-19 makale, kültürel etkiler-11 makale) üzerine araştırmalar yürütülmektedir. Festivalle ilgili kişi ve kurumların örneklem olarak ele alındığı çalışmalar ise daha çok sosyal etkiler (11 makale) ve ekonomik etkiler (7 makale) ile ilgilidir.

3.2.Ulusal Makaleler ile İlgili Bulgular

Ulusal makaleler ile ilgili temel bulgular Tablo 6'da görüldüğü gibidir. Türkiye'de festivallerin etkileri ile ilgili araştırmalar 2008 yılında başlamaktadır. Etki türü açısından değerlendirildiğinde Türkiye'de uluslararası alandaki çalışmaların aksine sosyal etkiler daha fazla çalışılmıştır. Sosyal etkileri ekonomik, kültürel, çevresel, bireysel ve mekânsal etkiler izlemektedir.

Türkiye'de yayınlanan festivallerin etkileri ile ilgili çalışmaların yayınlandığı dergiler incelendiğinde Uluslararası Sosyal ve Ekonomik Bilimler Dergisi (3 makale) ve Journal of Tourism and Gastronomy Studies (3 makale) dergileri dışında çeşitli üniversitelerin fakülte ve enstitü dergileri öne çıkmaktadır.

İncelenen festivallerin türüne bakıldığında Türkiye'de yerel festivallere yönelik araştırmaların (15 festival) sanat festivallerine (2 festival) göre daha yoğun olduğu görülmektedir. İncelenen festivallerin gerçekleştiği destinasyonlar açısından öne çıkan bir destinasyon olmamakla birlikte İzmir ve Beypazarı'nda gerçekleşen festivaller daha fazla incelenmiştir.

Ulusal çalışmalarda yöntem olarak nicel ve nitel yaklaşım birbirine yakın oranlarda iken, veri toplama yöntemleri olarak anket ve görüşme kullanılmaktadır. Araştırmalarda örneklem olarak yerel halk, ziyaretçiler başta olmak üzere yerel işletmeler, yerel yönetimler ve festival ile ilgili kişi ve kurumlar üzerinde çalışılmıştır.

Tablo 6. Ulusal Makaleler ile İlgili Bulgular

| Yıl | Makale Sayısı | Etki Türü | Makale Sayısı |
|--------------------------------|----------------------|--------------------------------|----------------------|
| 2008 | 2 | Sosyal | 13 |
| 2012 | 1 | Ekonomik | 12 |
| 2013 | 3 | Kültürel | 9 |
| 2014 | 1 | Çevresel | 4 |
| 2015 | 3 | Bireysel | 4 |
| 2016 | 3 | Mekansal | 3 |
| 2017 | 5 | İncelenen Festival Türü | Makale Sayısı |
| 2018 | 2 | Yerel festivaller | 15 |
| Yöntem | Makale Sayısı | Sanat Festivalleri | 2 |
| Nicel | 11 | Müzik | 1 |
| Nitel | 9 | Karma | 1 |
| Veri Toplama Yöntemi | Makale Sayısı | Alışveriş Festivali | 1 |
| Anket | 10 | | |
| Görüşme | 9 | | |
| İkincil Kaynak | 1 | | |
| Örneklem Türü | Makale Sayısı | | |
| Yerel halk | 7 | | |
| Ziyaretçiler | 5 | | |
| Yerel işletmeler | 3 | | |
| Yerel Yönetimler | 3 | | |
| Festival ile ilgili kişi-kurum | 1 | | |

4.TARTIŞMA VE SONUÇ

Festivallerin etkileri ile ilgili makalelerin incelenmesi ile hangi etki türlerinin, hangi festival örnekleri ve yöntem ile incelendiğinin ortaya konması ve festivallerin etkileriyle ilgili literatürdeki genel durumu analiz etmek amaçlanmış ve uluslararası ve ulusal alandaki çalışmaların karşılaştırılması da mümkün olmuştur. Tablo 7 uluslararası ve ulusal makalelere yönelik yürütülmüş analiz ile ilgili ulaşılan bulguların genel bir değerlendirmesini göstermektedir. Tablodaki genel değerlendirme çerçevesinde *uluslararası çalışmalara* yönelik aşağıdaki tespit ve önerileri yapmak mümkündür:

Uluslararası makalelerde ekonomik etkiler ile ilgili çalışmaların son yıllarda azaldığı, birden fazla etki türünün birlikte incelendiği görülmektedir. Bu doğrultuda uluslararası alanda diğer etki türleri ile ilgili çalışmalara ağırlık verilebilir.

Uluslararası makalelerde bireysel ve mekansal etkiler ile ilgili çalışmaların sayısı görece azdır. Bu etkiler ile ilgili çalışmalar yürütülebilir

Uluslararası makalelerde müzik ve karma sanat festivallerine yönelik çalışmalara ağırlık verildiği görülmektedir. Bu doğrultuda sanat festivalleri ile ilgili çalışmalar farklı sanat türlerine yönelik festivaller çerçevesinde yürütülebilir.

Uluslararası makalelerde etki arařtırmaları daha çok nicel yaklařım benimsenerek yürütölmektedir. Festival etki arařtırmalarında farklı arařtırma yöntem ve tekniklerinden yararlanılabilir. Nitel arařtırmaya ağırlık verilebilir.

Tablo 7. Genel Deęerlendirme

| | Uluslararası Makaleler | Ulusal Makaleler |
|-----------------------------|---|---|
| Makale sayısı | 113 | 20 |
| Zaman | 1980'ler ve sonrası çalışmalar bařlıyor. 2000'li yıllarda yoğunlařıyor. | 2008 ve sonrası |
| Dergi | Etkinlik yönetimi, festival ve turizm ile ilgili dergiler | Belirgin bir dergi profili yok |
| Etki Türü | Ekonomik etki çalışmaları çok yoğun. Son yıllarda ekonomik etki çalışmalarının azaldığı ve dięer etki türleri ile ilgili arařtırmaların arttığı görölmöyor. | Türkiye'de ekonomik etkiler çalışılmakla birlikte uluslararası makalelerde göröldüğü gibi baskın bir çalışma yoğunluğu yoktur. Aksine sosyal etkiler ekonomik etkilerden daha fazla çalışılmış. Ekonomik etki çalışmaları yapılandırılmış arařtırmalar ve ekonometrik analizler yoluyla yürütölmemiř. |
| Festival Türü | Yerel festivaller ve sanat festivalleri birbirine yakın oranlarda çalışılmış. | Yerel festivaller ağırlıklı |
| Sanat Festivali Türü | Çalışmalar, müzik festivalleri ağırlıklı. Karma festivaller onu takip ediyor. Ancak incelenen karma sanat festivallerinin sayısında son dönemlerde düşüş görölmöyor. Bunun yerine film festivallerinin çalışıldığı görölmöyor. | Müzik Karma Sanat festivalleriyle ilgili etki çalışmaları nicelik olarak çok yetersiz. |
| Destinasyon | ABD ve Kanada (son yıllarda düşüş gerçekteşmiş) Avustralya, İngiltere ve Çin artmış. Türkiye'de gerçekteşen festivaller son yıllarda incelenmeye başlanmış. | İzmir, Beypazarı Öne çıkan belirgin bir destinasyon yok. |
| Yöntem | Nicel arařtırma – Anket ağırlıklı bir arařtırma yaklařımı mevcut. Festivallerin etkileriyle ilgili geliştirilmiş ölçeklerden yararlanılıyor. | Nicel ve nitel arařtırma (anket ve görüşme) yakın oranlarda çalışılmış. Uluslararası literatürde festival etkileriyle ilgili geliştirilmiş ölçeklerden yararlanılmamış. |
| Örnekleme | Ziyaretçi, yerel halk, katılımcılar, etkinlik ile ilgili kiři ve kurumlar, yerel işletmelere yönelik çalışılmış. Ekonomik etki çalışmalarında ziyaretçiler; sosyo-kültürel etki çalışmalarında yerlilere yönelik arařtırmalar yürütölmüş. | Ziyaretçiler, yerel halk, katılımcılar, yerel işletmeler İncelenen etki türüne göre belirgin bir ayırım yok. |

Yapılan analiz doęrultusunda festivallerin etkileri konusundaki *ulusal çalışmalara* yönelik ařağıdaki tespit ve önerileri yapmak mümkündür:

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Festivallerin etkileri ile ilgili ulusal alanda yürütülen çalışmalar hem nitelik hem de nicelik olarak yetersiz kalmaktadır. Bu doğrultuda festivallerin yarattığı tüm etki türleri ile ilgili ulusal çalışmalara ağırlık verilebilir.

Ulusal makalelerde ekonomik etkilere yönelik çalışmaların yapılandırılmış araştırmalar ve ekonometrik analizler yoluyla ayrıntılı incelenmediği görülmektedir. Bu doğrultuda ulusal çalışmalarda ekonomik etkiler ile ilgili yapılandırılmış araştırmalara ihtiyaç olduğu ifade edilebilir.

Ulusal alanda yürütülen çalışmalarda yerel festivallere ağırlık verilmektedir. Bu doğrultuda festivallerin etkilerine yönelik araştırmalarda sanat festivalleri ile ilgili etki çalışmaları yürütülebilir.

Ulusal makalelerde festivallerin etkilerine yönelik araştırmaların önemli bir kısmında festival etkilerine yönelik geliştirilmiş ölçeklerden yararlanılmamaktadır. Bu doğrultuda uluslararası literatürde kullanılan ölçeklerden yararlanılarak etki araştırmaları yürütülebilir.

Bu çalışmada festivallerin ekonomik, sosyal, kültürel, çevresel, bireysel ve mekânsal etkilerine yönelik makaleler incelenmiştir. Gelecek araştırmalarda makale dışındaki diğer yayınlar da değerlendirilebilir. Diğer taraftan bu çalışmada sadece festivallerin etkilerine odaklanılmıştır. Gelecek çalışmalarda farklı etkinlik türleri ve yarattıkları etkiler karşılaştırmalı olarak incelenebilir.

KAYNAKÇA

- Andersson, T.D. ve Lundberg, E. (2013) “Commensurability and Sustainability: Triple Impact Assessments of a Tourism Event”, *Tourism Management*, 37: 99-109
- Andersson, T.D., Jutbring, H. ve Lundberg, E. (2013) “When a music festival goes veggie: Communication and environmental impacts of an innovative food strategy”, *International Journal of Event and Festival Management*, 4(3): 224-235
- Attanasi, G., Casoria, F., Centorrino, S. ve Urso, G. (2013) “Cultural Investment, Local Development and Instantaneous Social Capital: A Case Study of a Gathering Festival in the South of Italy”, *The Journal of Socio-Economics*, 47: 228-247
- Bracalente, B., Chirieleison, C., Cossignani, M., Ferrucci, L., Gigliotti, M., ve Ranalli, M. G. (2011) “The Economic Impact of Cultural Events: The Umbria Jazz Music Festival”, *Tourism Economics*, 17(6): 1235–1255
- Brannas, K., ve Nordstrom, J. (2006) “Tourist Accommodation Effects of Festivals”, *Tourism Economics*, 12 (2): 291-302.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Brown, M., Var, T. ve Lee, S. (2002) "Messina Hof Wine and Jazz Festival: An Economic Impact Analysis", *Tourism Economics*, 8 (3): 273-279.
- Chang, S.C., Lin, T.H., Young, C.Y. ve Lee, C.T. (2011) "The Impact of Ground-level Fireworks (13 km long) Display on the Air Quality during the Traditional Yanshui Lantern Festival in Taiwan", *Environmental Monitoring and Assessment*, 172(1-4): 463-479
- Chen, S.C. (2011) "Residents' Perceptions of the Impact of Major Annual Tourism Events in Macao: Cluster Analysis", *Journal of Convention & Event Tourism*, 12(2): 106-128
- Cizmic, E. ve Causevic, A. (2017) "Impact of Event Tourism in a Tourist Destination Quality of Experience – Case of the Sarajevo Film Festival", *Universal Journal of Management* 5(7): 332-340
- Crespi-Vallbona, M. ve Richards, G. (2007) "The Meaning of Cultural Festivals", *International Journal of Cultural Policy*, 13(1): 103-122
- Crompton, J., Lee, S., ve Shuster, T. (2001) "A Guide for Undertaking Economic Impact Studies: The Springfest Example", *Journal of Travel Research*, 40 (1): 79–87.
- Cudny, W., Korec, P. ve Rouba, R. (2012) "Residents' Perception of Festivals-A Case Study of Lodz", *Sociologia*, 44(6): 704-728
- De Bres, K., & Davis, J. (2001) "Celebrating Group and Place Identity: A Case Study of a New Regional Festival", *Tourism Geographies*, 3 (3): 326-337.
- Derrett, R. (2003). "Making Sense of How Festivals Demonstrate a Community's Sense of Place", *Event Management*, 8(1): 49-58
- Derrett, R. (2004). "Festivals, Events and the Destination". Ian Yeoman, Martin Robertson, Jane Ali-Knight, Siobhan Drummond ve Una McMahon-Beattie (Eds) *Festival and Event Management: An International Arts and Culture Perspective*, Oxford, Butterworth-Heinemann.
- Felsenstein, D. ve Fleischer, A. (2003) "Local Festivals and Tourism Promotion: The Role of Public Assistance and Visitor Expenditure", *Journal of Travel Research*, 41: 385-392
- Fredline, E., Jago, L. ve Deery, M. (2003) "The Development of a Generic Scale to Measure the Social Impacts of Events", *Event Management*, 8(1): 23-37.
- Getz, D. (1997) "Event Management & Event Tourism", New York: Cognizant Communication Corporation

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Getz, D. (2010) "The Nature and Scope of Festival Studies", *International Journal of Event Management Research*, 5 (1): 1-47
- Gonzalez, F. ve Miralbell, O. (2011) "The Role of Social and Intangible Factors in Cultural Event Planning in Catalonia", *International Journal of Event and Festival Management*, 2(1): 37-53
- Gursoy, D., Kim, F. ve Uysal, M. (2004) "Perceived Impacts of Festivals and Special Events by Organizers: An Extension and Validation", *Tourism Management*, 25(2): 171–181
- Gül, K., Erdem, B. ve Gül, M. (2013) "Yerel Festivallerin Etkinliğine Bağlı Ziyaretçi Kazanımları: Sındırgı Yağcıbedir Festivali Örneği", *Süleyman Demirel University The Journal of Faculty of Economics and Administrative Sciences*, 18 (2): 213-239.
- Han, J., Wang, W., Zheng, C. ve Zhang, J. (2017) "Host Perceptions of Music Festival Impacts: Time and Space Matter?", *Asia Pacific Journal of Tourism Research*, 22(11): 1156-1168
- Hede, A.M. ve Jago, L. (2005) "Perceptions of the Host Destination as a Result of Attendance at a Special Event: A Post-Consumption Analysis", *International Journal of Event Management Research*, 1(1): 1-11
- Huang, K., Zhuang, G., Lin, Y., Wang, Q., Fu, J.S., Zhang, R., Li, J., Deng, C. ve Fu, Q. (2012) "Impact of Anthropogenic Emission on Air Quality over a Megacity – Revealed from an Intensive Atmospheric Campaign during the Chinese Spring Festival", *Atmospheric Chemistry and Physics*, 12: 11631-11645
- Kim, K., ve Uysal, M. (2003) "Perceived Socio-economic Impacts of Festivals and Events among Organizers" *Journal of Hospitality & Leisure Marketing*, 10(3–4): 159–171.
- Kruger, M., Saayman, M. ve Ellis, S.M. (2010) "Determinants of Visitor Expenditure at the Aardklop National Arts Festival" *Event Management*, 14(2): 137-148
- Lee, S. ve Crompton, J. (2003) "The Attraction Power and Spending Impact of Three Festivals in Ocean City, Maryland" *Event Management*, 8 (2): 109-112.
- Lim, M., Hellard, M., Hocking, J. ve Aitken, C. (2008) "A Cross-sectional Survey of Young People Attending a Music Festival: Associations between Drug Use and Musical Preference" *Drug and Alcohol Review*, 27 (4): 439-441.
- Litvin, S.W. ve Fetter, E. (2006) "Can a Festival be too Successful? A Review of Spoleto, USA" *International Journal of Contemporary Hospitality Management*, 18(1): 41-49.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Long, P. T. ve Perdue, R. R. (1990) "The Economic Impact of Rural Festivals and Special Events: Assessing the Spatial Distribution of Expenditures" *Journal of Travel Research*, 61: 19-14.
- Mair, J. ve Laing, J. (2012) "The Greening of Music Festivals: Motivations, Barriers and Outcomes: Applying the Mair and Jago model" *Journal of Sustainable Tourism*, 20(5): 683–700.
- Marks, M., Chandler, L. ve Baldwin, C. (2016) "Re-imagining the Environment: Using an Environmental Art Festival to Encourage Pro-environmental Behaviour and a Sense of Place" *Local Environment*, 21(3): 310-329
- Mitchell, C. ve Wall, G. (1989) "The Arts and Employment: A Case Study of the Stratford Festival" *Growth and Change*, 20 (4): 31-40.
- Nurse, K. (2004) "Trinidad Carnival: Festival tourism and cultural industry" *Event Management*, 8 (4): 223-230
- O'Sullivan, D. ve Jackson, M. J. (2002) "Festival Tourism: A Contributor to Sustainable Local Economic Development?" *Journal of Sustainable Tourism*, 10(4): 325–342.
- Özgürel, G., Alan, R. ve Bingöl, Z. (2015) "Yerel Kalkınmada Bir Araç Olarak Festivaller: Munzur Kültür ve Doğa Festivali" *Uluslararası Sosyal ve Ekonomik Bilimler Dergisi*, 5(2): 113-121.
- Özkan, E. Curkan, S.C. ve Sarak, E.C. (2015) "Festivallerin Katılan Ziyaretçiler Üzerine Etkileri: Alaçatı Ot Festivali Örneği" *Gümüşhane Üniversitesi Sosyal Bilimler Elektronik Dergisi*, 6(14): 56-59.
- Packer, J. ve Ballantyne, J. (2011) "The Impact of Music Festival Attendance on Young People's Psychological and Social Well-Being" *Psychology of Music*, 39(2): 164–181
- Quinn, B. (2006) "Problematising 'Festival Tourism': Arts Festivals and Sustainable Development in Ireland" *Journal of Sustainable Tourism*, 14(3): 288–306.
- Rafiee, A., Gori, E., Lu, W., Miyata, Y. Shabani, H., Mortezaadeh, S. ve Hoseini, M. (2018) "The Impact of Various Festivals and Events on Recycling Potential of Municipal Solid Waste in Tehran, Iran" *Journal of Cleaner Production*, 183: 77-86
- Rao, V. (2001) "Celebrations as Social Investments: Festival Expenditures, Unit Price Variation and Social Status in Rural India" *The Journal of Development Studies*, 38(1): 71–97.
- Rivera, M.A., Semrad, K.J. ve Croes, R. (2015) "The Internationalization Benefits of a Music Festival: The Case of the Curaçao North Sea Jazz Festival" *Tourism Economics*, 22(5): 1087-1103

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Saayman, M. ve Rossouw, R. (2010) "The Cape Town International Jazz Festival: More than Just Jazz" *Development Southern Africa*, 27(2): 255-272
- Saayman, M. ve Rossouw, R. (2011) "The Significance of Festivals to Regional Economies: Measuring the Economic Value of the Grahamstown National Arts Festival in South Africa" *Tourism Economics*, 17(3): 603-624
- Sharpe, E.K. (2008) "Festivals and Social Change: Intersections of Pleasure and Politics at a Community Music Festival" *Leisure Sciences*, 30(3): 217-234,
- Shuib, A., Edman, S. ve Yaakub, F. (2013) "Direct Expenditure Effects of the Rainforest World Music Festival 2009 In Santubong, Sarawak" *International Journal of Business and Society*, 14(2): 287-298
- Small, K. (2007) "Social Dimensions of Community Festivals: An Application of Factor Analysis in the Development of the Social Impact (SIP) Scale" *Event Management*, 11 (1/2): 45-55.
- Tang, Q. ve Turco, D. (2001) "Spending Behaviors of Event Tourists" *Journal of Convention & Exhibition Management*, 3 (2): 33-40
- Thakur, B., Chakraborty, S., Debsarkar, A., Chakraborty, S. ve Srivastava, R.C. (2010) "Air Pollution from Fireworks During Festival of Lights (Deepawali) in Howrah, India – a Case Study" *Atmosfera*, 23(4)
- Tohmo, T. (2005) "Economic Impact of Cultural Events on Local Economies: An Input-Output Analysis of the Kaustinen Folk Music Festival" *Tourism Economics*, 11(3): 431-451
- Turco, D. (1995) "Measuring the Tax Impacts of an International Festival: Justification for Government Sponsorship" *Festival Management and Event Tourism*, 2 (3/4): 191-195.
- Wood, E. (2005) "Measuring the Economic and Social Impacts of Local Authority Events" *International Journal of Public Sector Management*, 18 (1): 37-53.
- Xiao, H. ve Smith, S. (2004) "Residents Perceptions of Kitchener-Waterloo Oktoberfest: An Inductive Analysis" *Event Management*, 8 (3): 161-175.
- Yemenoğlu, E. (2013) "Geleneksel Festivallerin Kırsal Turizm Üzerindeki Etkileri: Denizli-Honaz Kiraz Festivali Örneği" *Uluslararası Sosyal ve Ekonomik Bilimler Dergisi* 3(1): 16-21.
- Yolal, M., Çetinel, F. ve Uysal, M. (2009) "An Examination of Festival Motivation and Perceived Benefits Relationship: Eskişehir International Festival" *Journal of Convention & Event Tourism*, 10(4): 276-291

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Yolal, M., Gursoy, D., Uysal, M., Kim, H.L. ve Karacaoğlu, S. (2016) "Impacts of Festival and Events on Residents' Well-being" *Annals of Tourism Research*, 61: 1-18

Yolal, M., Rus, R. V., Cosma, S. ve Gursoy, D. (2015) "A Pilot Study on Spectators' Motivations and Their Socio-Economic Perceptions of a Film Festival" *Journal of Convention & Event Tourism*, 16(3): 253–271

Yuen, F.ve Glover, T. (2005) "Enabling Social Capital Development: An Examination of the Festival of Neighbourhoods in Kitchener, Ontario" *Journal of Park and Recreation Administration*, 23(4): 20-38

Zuoping, S. ve Jianxue, Z. (1995) "The Impact of the Firing the Fireworks in the Spring Festival Eve to Urban Environment" *Environmental Protection Science*, 2



DESTİNASYON MARKA DENKLİĞİNİN TURİST MEMNUNİYETİ VE YENİDEN ZİYARET NİYETİNE ETKİSİ: ESKİŞEHİR ÖRNEĞİ

Eylin AKTAŞ*

ÖZET

Destinasyon markalaşması süreci çeşitli marka unsurlarına, genel olarak ise marka denkliğine odaklanılmasını gerektirmektedir. Destinasyon markalaşması literatüründe destinasyon marka denkliği unsurları olarak destinasyon farkındalığı, destinasyon imajı, algılanan kalite, destinasyon sadakati ve destinasyon marka değeri boyutları incelenmektedir. Diğer taraftan turizm destinasyonlarına yönelik ziyaretlerin yarattığı turist memnuniyeti ve söz konusu destinasyonu yeniden ziyaret etme niyeti ise destinasyon markalaşma süreci bakımından önem taşımaktadır. Bu doğrultuda bu çalışmanın amacı; destinasyon marka denkliği boyutları (destinasyon farkındalığı, destinasyon imajı, algılanan kalite, destinasyon sadakati ve destinasyon marka değeri) ile turist memnuniyeti ve yeniden ziyaret niyeti arasındaki ilişkileri Eskişehir örneği çerçevesinde incelemektir. Bu amaç doğrultusunda Eskişehir'i ziyaret etmiş olan yerli turistlere yönelik bir nicel araştırma yürütülmüştür. Araştırmada yüz yüze ve çevrim içi ortamda anket formu yoluyla veri toplanmış ve 607 yerli turistin yer aldığı bir örneklem ile çalışılmıştır. Araştırma bulguları, destinasyon imajı boyutu hariç diğer marka denkliği boyutlarının turist memnuniyetini ve destinasyonu yeniden ziyaret etme niyetini olumlu etkilediğini göstermektedir.

Anahtar Kelimeler: Destinasyon Marka Denkliği, Turist Memnuniyeti, Yeniden Ziyaret Niyeti.

JEL Kodları: Z33, M30.

DESTINATION BRAND EQUITY'S INFLUENCE ON TOURIST SATISFACTION AND INTENTION TO VISIT AGAIN: CASE OF ESKİŞEHİR

ABSTRACT

The process in which destination becomes a brand requires a focus on various brand factors, especially on brand equity in general. In the literature of destination branding, analysis is conducted on various factors of destination brand equity such as destination awareness, destination image, perceived quality, destination loyalty and destination brand value. On the other hand, tourists' satisfaction resulting from the visits to tourism destinations as well as their intentions of revisiting the

* Pamukkale Üniversitesi, İletişim Fakültesi, Halkla İlişkiler ve Tanıtım Bölümü, Denizli, ebabacan@pau.edu.tr

destination in question are also important factors in terms of destination branding process. The aim of this study is to analyze relations of destination brand equity factors (destination awareness, destination image, perceived quality, destination loyalty and destination brand value) with tourist satisfaction and intention to visit again within the frame of the case of Eskişehir. In line with this purpose, a quantitative study was conducted on domestic tourists who have visited Eskişehir. Study's data were gathered by means of a questionnaire implemented face-to-face and on online platform, and a sample consisting of 607 domestic tourists was used. Findings of the study showed that tourist satisfaction and intention to visit again were positively influenced by brand equity factors, with the exception of destination image factor.

Keywords: *Destination Brand Equity, Tourist Satisfaction, Intention to Visit Again.*

JEL Codes: *Z33: Marketing And Finance, M30: General.*

1.GİRİŞ

Günümüz rekabetçi pazar ortamı, sadece ürün ve hizmetler için değil, aynı zamanda birer turizm destinasyonu olan kentler için de farklılaşmayı bir gereklilik olarak ortaya koymaktadır. Özellikle destinasyonların soyut ve ikame edilebilirlik özelliği, beraberinde markalaşmaya ilişkin uygulamaların önemini de getirmektedir. Bu nedenle günümüz kentleri, birer turizm destinasyonu olarak markalaşma çabası içine girmekte ve bu markalaşma sürecini rakiplerinden farklılaşmanın bir yolu olarak tasarlama amacı ile süreci yönetmektedirler. Rekabet avantajı yaratmanın en güçlü yollarından biri de destinasyonlar olarak kent markaları yaratmaktır. Destinasyon markalaşması süreci çeşitli marka unsurlarına, genel olarak ise marka denkliğine odaklanılmasını gerektirmektedir.

Eskişehir turist sayısının giderek arttığı ve ülkemizin önemli marka kentlerinden biri olarak tanımlanabilir. Bir turizm destinasyonu olarak Eskişehir'e yönelik markalaşma yönünde de çalışmalar sürdürülmektedir. Eskişehir'e yönelik müşteri tabanlı marka denkliği boyutları çerçevesinde yürütülmüş bir çalışmaya rastlanmamıştır. Bu doğrultuda bu çalışmanın amacı, Eskişehir örneği çerçevesinde müşteri tabanlı destinasyon marka denkliği boyutları ile turist memnuniyeti ve turistlerin yeniden ziyaret niyeti arasındaki ilişkiyi ortaya koymaktır.

2. LİTERATÜR ÖZETİ

Destinasyon markalaşması, 1990'lı yıllardan beri üzerinde tartışılan akademik bir alan olarak giderek daha da önem kazanmaktadır. Destinasyon markalaşması literatürü, marka ve markalaşma literatüründen beslenmekte ve bu alan kendi dinamikleri çerçevesinde geliştirilmektedir. Ürün ve hizmet markalaşması literatürünün gelişmişliğine rağmen, genel olarak yerlerin ve turizm bağlamında

düşünüldüğünde de destinasyon markalaşmasının bu genç yapısı, araştırmacılara, üzerinde tartışılacak ve araştırılacak pek çok yeni boyutun var olması gibi önemli bir fırsat sunmaktadır.

Destinasyon markalaşması, çok boyutlu, çok değişkenli bir yapı gösteren ve her biri önemli uzmanlık alanları olan çeşitli disiplinlerin bir arada tartışılması, organize edilmesi, planlanması ve yönetilmesi gereken bir akademik alan ve uygulama alanıdır. Blain, Levy ve Ritchie (2005:337) tarafından yapılan tanıma göre “destinasyon markalaşması a) bir destinasyonu kolaylıkla tanımlayan ve farklılaştıran bir isim, sembol, logo, sözcük veya grafiğin yaratılmasını destekleyen, b) sadece o destinasyon ile ilişkilendirilmiş unutulmaz bir seyahat deneyimi beklentisini sürekli olarak açığa çıkaran, c) ziyaretçi ile destinasyon arasındaki duygusal bağlantıyı pekiştiren ve güçlendiren, d) tüketici araştırma maliyetlerini ve algılanan riski azaltan bir pazarlama uygulamaları bütünü olarak tanımlamaktadır. Cai (2002:722) ise destinasyon markalaşmasını, “olumlu bir imaj yapılandırmasına yönelik olarak markayı tanımlayan ve ayrıştıran tutarlı bir karmanın oluşturulması” olarak tanımlamaktadır. Diğer taraftan markanın başarılı bir biçimde yapılandırılmasının tutarlı ve güçlü bir destinasyon kimliğinin de temelinde yattığını iddia edilmektedir (Cai, 2002).

Destinasyon markalaşmasına ilişkin çalışmalar müşteri tabanlı marka denkleğinin ölçümü üzerinde yoğunlaşmaktadır. Boo, Busser ve Baloğlu (2009), Pike (2007; 2004), Gartner, Taşçı ve So (2007), Konecnik ve Gartner (2007), Konecnik (2005), Kladou ve Kehagias (2014) gibi turizm araştırmacıları marka kuramının destinasyonlara nasıl uygulanacağına ilişkin bir başlangıç noktası olarak Aaker'ın (1991) müşteri tabanlı marka denkleği modelinin temel alınması gerektiğini iddia etmektedirler.

Destinasyonlar için müşteri tabanlı marka denkleğine ilişkin çalışmalar yürüten araştırmacılar, marka denkleğini ortaya çıkaran unsurları belirlemeye ve ölçümlemeye çalışmışlardır. Gartner (2007) destinasyon marka denkleğinin şu unsurlardan oluştuğunu ifade etmektedir: a) Farkındalık, b) çağrışımlar veya imaj, c) algılanan kalite, d) sadakat, e) değer. Taşçı, Gartner ve Çavuşgil (2007:1529) marka denkleğinin turizm pazarı tarafından taşınan farklı marka boyutlarının değerleri ile ilgili olduğunu söylemektedirler.

Konecnik ve Gartner (2007) bir turizm destinasyonu için marka denkleğinin farklı boyutlarını araştırmışlardır. Bu araştırmada parasal bir değer belirlenmemesine rağmen bulgular, farklı pazarların, farklı marka boyutlarının değerini farklı bir şekilde ele aldığını göstermiştir. Müşteri tabanlı marka denkleğini destinasyonlara uyarlayan Konecnik ve Gartner (2007) bir destinasyon markasının dört boyutu olduğunu iddia etmekte ve bu boyutları test etmektedirler. Bu boyutlar; destinasyon farkındalığı, destinasyon imajı, destinasyon kalitesi ve destinasyon sadakatidir. Yazarlar bu değişkenler arasında

pozitif bir ilişki olduğunu ortaya koymakta ve destinasyon imajının, markaya ilişkin değerlendirmelerin ve marka denkliğinin merkezinde yer aldığını ifade etmektedirler. Ancak müşteri tabanlı marka denkliğinin ölçülmesi için diğer boyutların da gerekliliğine vurgu yapılmaktadır.

Boo, Busser ve Baloğlu (2009) da, Konecnik ve Gartner (2007), Gartner, Taşçı ve So (2007) ile uyumlu olarak müşteri tabanlı marka denkliğinin ölçümünde destinasyon farkındalığı, destinasyon imajı, destinasyon kalitesi ve destinasyon sadakati boyutlarının yanı sıra destinasyon değeri boyutunu da kullanmışlardır. Farklı olarak Boo, Busser ve Baloğlu (2009) araştırma sonucunda destinasyon marka deneyimi boyutunun da müşteri tabanlı marka denkliği ölçümünde kullanılması gereken boyutlardan biri olduğu sonucuna ulaşmıştır.

Destinasyon marka denkliği boyutlarına bakıldığında, marka farkındalığı Aaker (1991) tarafından potansiyel bir alıcının, markanın belirli bir ürün kategorisinin üyesi olduğunu bilme veya hatırlama gücü olarak tanımlanmaktadır. *Destinasyon farkındalığı* ise destinasyon adı ve temel özelliklerinin hatırlanması yoluyla ölçümlenmektedir (Konecnik ve Gartner, 2007). Bu doğrultuda bir destinasyonun öncelikle farkındalık yaratması gerekmektedir.

Marka imajı, anlamlı bir biçimde örgütlenmiş bir dizi çağrışım olarak çeşitli iletişimler sonucunda tüketicinin zihninde oluşturduğu algılamalardır (Uztuğ, 2002:40). *Destinasyon imajı* ise “bir yere ilişkin izlenim” ya da “bir alana ilişkin algı” (Echtner ve Ritchie, 2003:41) olarak tanımlanmaktadır.

Algılanan kalite, müşterilerin bir ürün veya hizmetin toplam kaliteye veya üstünlüğe ilişkin algılamaları olarak tanımlanmaktadır (Aaker, 1991:85). Destinasyon markalaşmasında algılanan kalite destinasyonda kamu veya özel sektör aracılığı ile sunulan hizmetlerin kalitesi ile ölçümlenmektedir.

Marka sadakati, tüketicinin duygusal, sembolik ve işlevsel düzeyde marka ile bağlantı kurmasının bir sonucudur (Bennett ve Rundle-Thiele, 2005:255). *Destinasyon sadakati*, tekrar eden ve diğerlerini yönlendiren bir davranış biçiminin gelişmesi ile ölçümlenmektedir (Pike, 2004)

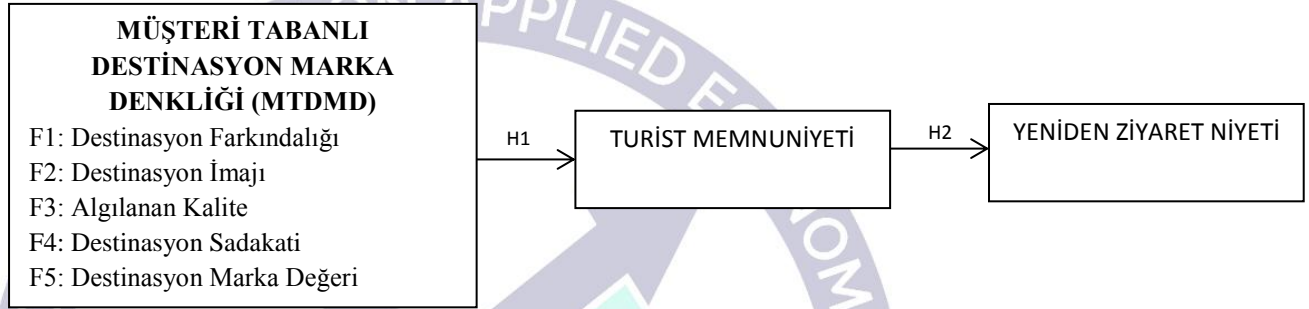
Değer ise, turistin destinasyonda harcadığı para ve buna ilişkin algılamaları düşünülerek ölçümlenmektedir. Bu doğrultuda temel unsurlar; “paranın değerli olması” veya “fiyatların uygunluğu” (Konecnik ve Gartner, 2007; Gartner, Taşçı ve So, 2007; Boo, Busser ve Baloğlu, 2009) olarak değerlendirilmektedir.

Literatürde destinasyon marka denkliği, memnuniyet ve yeniden ziyaret niyetini inceleyen çalışmalar da bulunmaktadır. Bu çalışmalarda destinasyon marka denkliği, memnuniyet ve yeniden ziyaret niyeti arasında olumlu ilişkiler bulunmuştur (Örn. Ferns ve Walls, 2012; Nam, Ekinci ve Whyatt, 2011)

3. YÖNTEM

Araştırmanın amacı, Eskişehir örneği çerçevesinde müşteri tabanlı destinasyon marka denkliği (5 boyut) ile turist memnuniyeti ve turistlerin yeniden ziyaret niyeti arasındaki ilişkiyi ortaya koymaktır. Bu amaç doğrultusunda yürütülen alan araştırması kapsamında anket yoluyla veri toplanmıştır. Şekil 1 araştırma modelini göstermektedir.

Şekil 1. Araştırma Modeli



Araştırma kapsamında uygulanan anket çalışması için seçilen *evren* Eskişehir'i ziyaret etmiş olan yerli turistlerdir. *Örnekleme* seçiminde tesadüfi olmayan örnekleme tekniklerinden kolayda örnekleme kullanılmış ve Eskişehir'i ziyaret etmiş olan yerli turistlerden veri toplanmıştır.

Tablo 1. Açıklayıcı Faktör Analizi Bulguları (n=529)

| Faktörler ve Maddeler | TMPK* | Faktör Yüklere | | | | |
|---|-------|----------------|----|----|----|-------|
| | | F1 | F2 | F3 | F4 | F5 |
| F1: Destinasyon Farkındalığı ($\alpha=0,870$) | | | | | | |
| Bir üniversite kentidir | 0,451 | | | | | 0,471 |
| Sağlıklı yaşam için ideal bir kenttir | 0,678 | | | | | 0,576 |
| Güvenli yaşam için ideal bir kenttir | 0,713 | | | | | 0,603 |
| Sosyal yaşam için ideal bir kenttir | 0,707 | | | | | 0,554 |
| Şehirleşme açısından örnek bir kenttir | 0,671 | | | | | 0,718 |
| Yeşil bir kenttir | 0,555 | | | | | 0,501 |
| Yaya haklarına saygılı bir kenttir | 0,616 | | | | | 0,612 |
| Kent içi ulaşım olanakları gelişmiş bir kenttir | 0,693 | | | | | 0,629 |
| F2: Destinasyon İmajı ($\alpha=0,837$) | | | | | | |
| Bir turizm bölgesi olarak çekiciliği | 0,623 | 0,615 | | | | |
| Doğal güzelliklerinin çeşitliliği | 0,588 | 0,697 | | | | |

| | | | | | | |
|---|-------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Turist enformasyonunun yeterliliği | 0,640 | 0,596 | | | | |
| Kültürel/tarihsel çekiciliklerin miktarı | 0,651 | 0,737 | | | | |
| Kent içindeki faaliyetlerinin yeterliliği | 0,595 | 0,662 | | | | |
| Yerel mutfağı | 0,521 | 0,499 | | | | |
| Alışveriş olanakları | 0,423 | 0,662 | | | | |
| Gece Hayatı ve Eğlence Olanakları | 0,489 | 0,738 | | | | |
| F3: Algılanan Kalite ($\alpha=0,916$) | | F1 | F2 | F3 | F4 | F5 |
| Restoranlarındaki hizmet kalitesi | 0,747 | | 0,758 | | | |
| Konaklama olanaklarının kalitesi | 0,911 | | 0,775 | | | |
| Otellerdeki hizmet kalitesi | 0,881 | | 0,780 | | | |
| Tur rehberleri tarafından verilen hizmet kalitesi | 0,716 | | 0,609 | | | |
| F4: Destinasyon Sadakati ($\alpha=0,854$) | | F1 | F2 | F3 | F4 | F5 |
| Gezmek için öncelikli bir kenttir | 0,669 | | | | 0,585 | |
| Bir sonraki gezimi gerçekleştireceğim kenttir | 0,722 | | | | 0,734 | |
| Gezilecek tek kenttir | 0,590 | | | | 0,581 | |
| Gelecekteki gezi planlarım arasındadır | 0,677 | | | | 0,779 | |
| Tavsiye edeceğim bir kenttir | 0,667 | | | | 0,745 | |
| Diğer yerlerden daha çok sevdiğim bir kenttir | 0,608 | | | | 0,723 | |
| F5: Algılanan Değer ($\alpha=0,930$) | | F1 | F2 | F3 | F4 | F5 |
| Genel olarak fiyatların uygunluğu | 0,789 | | | 0,838 | | |
| Yiyecek içecek fiyatlarının uygunluğu | 0,806 | | | 0,838 | | |
| Alışveriş fiyatlarının uygunluğu | 0,830 | | | 0,826 | | |
| Gece Hayatı ve Eğlence Fiyatlarının Uygunluğu | 0,782 | | | 0,782 | | |
| Konaklama fiyatlarının uygunluğu | 0,804 | | | 0,745 | | |
| Ulaşım fiyatlarının uygunluğu | 0,687 | | | 0,681 | | |
| Otellerde sunulan yiyecek içecek fiyatlarının uygunluğu | 0,750 | | | 0,770 | | |

Not: * Toplam madde puan korelasyonu, Kaiser-Meyer-Olkin Örneklem Uygunluğunun Ölçümü = 0,927, Bartlett Küresellik Testi (anlamlılık düzeyi) = 0,000, Genel Cronbach α = 0,955, Yaklaşık χ^2 = 5929,417, Açıklanan toplam varyans (%) = 68,3096, Her madde 5'li Likert ölçeği kullanılarak ölçülmüştür.

Veri toplama aracı olarak kullanılan anket formu oluşturulurken Konecnik (2005), Konecnik ve Gartner (2007), Gartner, Taşçı ve So (2007) ve Boo, Busser ve Baloğlu (2009) tarafından yürütülen araştırmalarda müşteri tabanlı destinasyon marka denkliği ölçümünde kullanılan beş boyut temel

alınmıştır (Destinasyon Farkındalığı, Destinasyon İmajı, Algılanan Kalite, Destinasyon Sadakati, Destinasyon Değeri). Söz edilen çalışmalarda MTDM ölçümünde kullanılan ölçeklerden yararlanılmıştır. Veri toplama aracı olarak kullanılan anket formu beş boyutlu, 45 maddelik MTDM ölçeği, turist memnuniyeti ve yeniden ziyaret niyeti ile ilgili ölçekler ve demografik sorulardan oluşmaktadır. Veri toplama aracında yer alan sorular, uzman grup tarafından incelenmiş ve araştırılmak istenen konuyla ilişkisi ve bu amaca hizmet edip etmedikleri bu şekilde değerlendirilmiştir. Veri, yüz yüze ve internet ortamında anket formu yoluyla toplanmıştır. 607 yerli turist soruları yanıtlamış, anket formlarının 529 kullanılabilir bulunmuştur (n=529).

MTDM ölçeğinin *geçerlilik ve güvenilirlik* analizi için kavramsal tanımlama, boyutluluk, geçerlilik ve güvenilirlik çalışması yapılmıştır. Anket formunda yer alan ölçek ve sorular, *kavramsal tanımlama* bakımından literatür ile uyumludur. Ölçeğin *boyutluluk* özelliği Hair ve diğerleri (1995:117) tarafından ölçekte kullanılan boyutları oluşturan maddelerin “birbirleriyle ilgili olmaları ve bir tek kavrama işaret etmeleri” olarak tanımlanmaktadır. Bu doğrultuda çalışmada kullanılan MTDM ölçeğine açıklayıcı faktör analizi uygulanmış ve Varimax dönüştürmesi ile açıklayıcı faktör analizinden elde edilen faktör yükleri, faktörleri test etmek ve düşük performans gösteren maddeleri elemek için dikkate alınmıştır. Her elenen madde sonrası analiz tekrar edilmiş ve maddeler literatür ve birbiri ile tutarlı boyutlara ulaşıncaya kadar analize devam edilmiştir. Açıklayıcı faktör analizi sonucunda 45 maddelik MTDM ölçeğinden 12 madde çıkarılmıştır.

Güvenilirlik için ise Hair ve diğerleri (1995) ve Churchill (1979) tarafından önerildiği gibi Cronbach alfa katsayıları ve toplam madde puan korelasyonları hesaplanmıştır. Tüm düzeyde Cronbach alfa katsayısı 0,955'dir. Açıklayıcı faktör analizi sonucunda ortaya çıkan 5 faktör için Cronbach alfa katsayıları ise 0,80 ila 0,93 arasında değişmektedir (Bkz Tablo 2). Diğer taraftan toplam madde puan korelasyonlarına bakıldığında tüm korelasyonların Nunnally (1970) tarafından önerilen 0,30 değerini, önemli bir kısmının ise (30 madde) Hair ve diğerleri (1995:118) tarafından önerilen 0,50 değerini aştığı görülmektedir (Bkz Tablo 1). Benzer olarak turist memnuniyeti ve yeniden ziyaret niyeti için kullanılan ölçeklerin Cronbach alfa katsayıları 0,897 ve 0,701'dir (Tablo 2) ve toplam madde puan korelasyonları bir madde hariç 0,50 değerini aşmaktadır.

Tablo 2. Ölçeklerin Alfa Katsayıları ve Madde Sayıları

| | Cronbach alfa α | Madde Sayısı |
|--------------------------|------------------------|--------------|
| Destinasyon Farkındalığı | 0,870 | 8 |
| Destinasyon İmajı | 0,837 | 8 |
| Algılanan Kalite | 0,916 | 4 |
| Destinasyon Sadakati | 0,854 | 6 |
| Destinasyon Değeri | 0,930 | 7 |
| MTDMD Ölçeği | 0,955 | 33 |
| Turist Memnuniyeti | 0,897 | 7 |
| Yeniden Ziyaret Niyeti | 0,701 | 3 |

4.BULGULAR

Örneklemin demografik özelliklerine bakıldığında örneklemin %51 erkek ve %49'unun kadın olduğu görülmektedir. Örneklemin önemli bir kısmı lisans ve üzeri (%87,7) eğitim düzeyine sahiptir. Yaş dağılımları incelendiğinde ise yanıtlayanların yarısından fazlasının 15-35 yaş aralığında (%58,1) olduğu görülmektedir.

Tablo 3.Örneklemin Demografik Özellikleri

| Cinsiyet | Frekans | Yüzde (%) | Yaş | Frekans | Yüzde (%) |
|----------------------|----------------|------------------|--------|---------|-----------|
| Kadın | 254 | 49 | 15-25 | 114 | 22 |
| Erkek | 264 | 51 | 26-35 | 204 | 39,4 |
| Toplam | 518 | 100 | 36-45 | 97 | 18,7 |
| Eğitim Düzeyi | Frekans | Yüzde (%) | 46-55 | 71 | 13,7 |
| İlköğretim | 8 | 1,5 | 56-65 | 30 | 5,8 |
| Lise | 55 | 10,5 | 65+ | 2 | 0,4 |
| Üniversite | 372 | 71,3 | Toplam | 518 | 100 |
| Lisansüstü | 87 | 16,4 | | | |
| Toplam | 522 | 100 | | | |

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Çalışmanın araştırma modelini test etmek amacıyla çoklu doğrusal regresyon analizi yürütülmüştür (Bkz Tablo 4). MTDMD ile turist memnuniyeti arasındaki ilişki incelendiğinde MTDMD boyutlarından destinasyon imajı boyutu (0,254 anlamlılık düzeyi, $P > 0,05$) hariç diğer boyutlar ile turist memnuniyeti arasında anlamlı pozitif bir ilişki bulunmuştur.

Tablo 4. Destinasyon Marka Denkliği Boyutları ile Memnuniyet Arasındaki İlişki (n=529)

| | Standartlaşmamış Katsayılar | | Standartlaşmış İş Katsayılar | t | P | Model R ² |
|--------------------------|-----------------------------|-------|------------------------------|-------|---------|----------------------|
| | B | SH | Beta | | | |
| Destinasyon Farkındalığı | 0,363 | 0,045 | 0,358 | 8,154 | 0,000* | 0,559 |
| Destinasyon İmajı | 0,055 | 0,049 | 0,056 | 1,142 | 0,254 | |
| Algılanan Kalite | 0,185 | 0,035 | 0,221 | 5,246 | 0,000* | |
| Destinasyon Sadakati | 0,105 | 0,034 | 0,132 | 3,073 | 0,002** | |
| Algılanan Değer | 0,143 | 0,034 | 0,159 | 4,214 | 0,000* | |

Not: * 0,001 düzeyinde anlamlıdır. ** 0,05 düzeyinde anlamlıdır. SH: Standart Hata

Turist memnuniyeti ile yeniden ziyaret niyeti arasındaki ilişki de araştırılmış ve bu doğrultuda doğrusal regresyon analizi yürütülmüştür (Tablo 5). Analiz bulguları turist memnuniyeti ile yeniden ziyaret niyeti arasında anlamlı ve pozitif bir ilişki olduğunu göstermektedir (0,000 anlamlılık düzeyi, $P < 0,001$).

Tablo 5. Turist Memnuniyeti ile Yeniden Ziyaret Niyeti Arasındaki İlişki (n=529)

| | Standartlaşmamış Katsayılar | | Standartlaşmış Katsayılar | t | P | Model R ² |
|--------------------|-----------------------------|-------|---------------------------|--------|--------|----------------------|
| | B | SH | Beta | | | |
| Turist Memnuniyeti | 0,605 | 0,056 | 0,434 | 10,769 | 0,000* | 0,188 |

Not: * 0,001 düzeyinde anlamlıdır. SH: Standart Hata

5.TARTIŞMA VE SONUÇ

Destinasyonların rekabet ortamı içerisinde farklılaşma ve sürdürülebilir bir avantaj yaratma gereksinimi, destinasyon markalaşmasından sorumlu kurum ve kuruluşların sürekli yenilenen ve güçlü bütünleşik marka iletişimi stratejileri oluşturması gerekliliğini beraberinde getirmektedir. Müşteri tabanlı destinasyon marka denkliği, turistlerin destinasyonlar ile ilgili algılarının, çağrışımlarının ve tutumlarının bir bütünü olarak ifade edilebilir. Bu doğrultuda destinasyon markalaşması bakımından

marka denkliği konusu, çeşitli boyutları içermesi sebebiyle karmaşık yapılar olarak destinasyonlar için bütüncül bir bakış açısı ve ölçüleme olanağı sunmaktadır. Güçlü bir marka denkliği beraberinde bölgeye yatırım çekilmesini, turist ve öğrenci hareketliliğini getirebilmekte ürün/destinasyon için daha yüksek bedeller ödeme sonucunu ortaya çıkarabilmektedir. Bu nedenle destinasyonlar markalaşma çabası içine girmekte ve marka denkliği boyutları çerçevesinde daha olumlu bir algı yaratmaya çalışmaktadırlar.

Araştırma bulguları incelendiğinde destinasyon imajı hariç MTDMD boyutları ile turist memnuniyeti ve turist memnuniyeti ile yeniden ziyaret niyeti arasında anlamlı pozitif ilişkiler olduğu görülmektedir. Bulgular, MTDMD'nin turist memnuniyeti ve yeniden ziyaret niyeti ilişkileri bakımından literatür ile uyumludur.

Çalışmada Eskişehir örneği ele alınarak marka denkliği boyutları, turist memnuniyeti ve yeniden ziyaret niyeti üzerinde çalışılmıştır. Farklı destinasyonlar için MTDMD boyutları üzerinde yeni çalışmalar yapılabilir ve benzer destinasyonların MTDMD boyutları karşılaştırılabilir. Bu çalışmada MTDMD boyutları olarak destinasyon farkındalığı, destinasyon imajı, algılanan kalite, destinasyon sadakati ve algılanan değer boyutları ele alınmıştır. Ancak marka kimliği, marka kişiliği gibi başka marka unsurları üzerine de araştırmalar yürütülebilir.

KAYNAKLAR

- Aaker, D. (1991) "Managing Brand Equity: Capitalizing on the Value of a Brand Name" New York: Free Press.
- Bennett, R. ve Rundle-Thiele, S. (2005) "The Brand Loyalty Life Cycle: Implications for Marketers" *Journal of Brand Management*, 12 (4): 250-263.
- Blain, C., Levy S.E. ve Ritchie, J.R.B. (2005) "Destination Branding: Insights and Practices from Destination Management Organizations" *Journal of Travel Research*, 43 (4): 328-338.
- Cai, A.L. (2002) "Cooperating Branding for Rural Destinations" *Annals of Tourism Research*, 29 (3): 720-742.
- Boo, S., Busser, J. ve Baloğlu, Ş. (2009) "A Model of Customer-Based Brand Equity and Its Application to Multiple Destinations" *Tourism Management*, 30 (2): 219-231.
- Echtner, C. M. ve Ritchie, J.R.B. (2003) "The Meaning and Measurement of Destination Image" *The Journal of Tourism Studies*, 14 (1): 37-48.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Ferns, B.H. ve Walls, A. (2012) "Enduring Travel Involvement, Destination Brand Equity, and Travelers' Visit Intentions: A Structural Model Analysis" *Journal of Destination Marketing & Management*, 1:27-35
- Gartner, W.C. (2007) "Deconstructing Destination Brand Equity" 2nd International Conference on Destination Branding and Marketing: New Advances and Challenges for Practice, Macao S.A.R., China.
- Gartner, W.C., Taşçı, A.D.A. ve So, S.I. (2007) "Branding Macao: An Application of Strategic Branding for Destinations" 2nd International Conference on Destination Branding and Marketing: New Advances and Challenges for Practice, Macao S.A.R., China.
- Hair, J.F.Jr., Anderson, R.E., Tahtam, R.L. ve Black, W.C. (1995) "Multivariate Data Analysis with Readings" New Jersey: Prentice Hall Inc.
- Kladou, S. ve Kehagias, J. (2014) "Assessing Destination Brand Equity: An Integrated Approach" *Journal of Destination Marketing & Management*, 3:2-10
- Konecnik, M. ve Gartner, W.C. (2007) "Customer-Based Brand Equity for a Destination" *Annals of Tourism Research*, 34 (2): 400-421.
- Konecnik, M. (2005) "Customer Based Brand Equity for Tourism Destination: Conceptual Model and its Empirical Verification" Unpublished PhD Thesis, University of Ljubljana, Slovenia.
- Nam, J., Ekinci, Y. ve Whyatt, G. (2011) "Brand Equity, Brand Loyalty and Consumer Satisfaction" *Annals of Tourism Research*, 38(3):1009-103
- Nunnally, J.C.Jr. (1970) "Introduction to Psychological Measurement" New York: Mcgraw-Hill.
- Pike, S. (2004) "Destination Marketing Organisations" Oxford: Elseiver Butterworth-Heinemann.
- Pike, S. (2007) "Customer-Based Brand Equity for Destinations: Practical DMO Performance Measures" *Journal of Travel & Tourism Marketing*, 22 (1): 51-61.
- Taşçı, A.D.A., Gartner, W.C. ve Çavuşgil, S.T. (2007) "Measurement of Destination Brand bias Using a Quasi-Experimental Design" *Tourism Management*, 28 (6): 1529-1540.
- Uztuğ, F. (2002) "Markan Kadar Konuş! Marka İletişimi Stratejileri" İstanbul: MediaCat Yayınları.

**FINANCIAL SECTOR DEVELOPMENT AND ECONOMIC GROWTH IN ALGERIA: AN
ARDL ANALYSIS 1980-2017**

FAHSI Zineb*

DJABRI Fatima Zahra**

ABSTRACT

This study empirically examines the relationship between financial sector development and economic growth in Algeria over the period 1980–2017 using the auto-regressive distributed lag approach to co-integration analysis, depending on real gross domestic product per capita as a dependent variable, broad money and domestic credit to private sector as a measure of financial development. Our results reveal that the relationship between financial development and economic growth in Algeria is not significantly different from what has been observed generally in oil-dependent economies. The relationship between financial development and economic growth in Algeria is found to be insignificantly positif. The results highlight the dominant role of the oil sector in economic activities. These findings suggest a dire need for financial reforms in Algeria in order to improve efficiency in the financial sector so as to stimulate investment and saving and thus, long-term economic growth.

Keywords: *Financial Development, Economic Growth, ARDL Method, Algeria.*

JEL Classification: *O11, O16, O47, C22, O55.*

1. INTRODUCTION

The importance of financial sector development in promoting economic growth has been studied extensively in the literature (e.g., Goldsmith, 1966, 1969; Gurley & Shaw, 1955, 1960; Patrick 1966; Porter, 1966; Khatldaate, 1972; McKinnon, 1973; and Bhatia & Khatkhate, 1975). Economic history contains many examples of linkages between financial sector development and economic growth, for example, from King and Levine (1993) study; the results suggested a significantly impact of financial development on economic growth. The objective of this paper is to examine the link between financial

* Ph.D. student, Djillali Liabes University of Sidi Bel Abbes, Faculty of Economics, Business and Management Sciences, Algeria, fahsi.zin@gmail.com

** Ph.D. student, Djillali Liabes University of Sidi Bel Abbes, Faculty of Economics, Business and Management Sciences, Algeria, djabrifatimazahra@gmail.com

sector development and economic growth in Algeria over the period 1980–2017, using the autoregressive distributed lag approach to co-integration analysis.

2. LITERATURE REVIEW

Many developing economies have recently implemented a wide variety of financial liberalization measures that have led to significant changes in their financial structures. At the same time, some of these economies have managed to achieve high rates of economic growth, while others have lagged behind. Although differences in their economic performance can be attributed to many factors, there is a growing belief among economists that financial development has played an important role in promoting this high rate of economic growth.

Financial development is generally defined as the improvement in quantity, quality and efficiency of financial intermediary services. Whilst theoretical economists were trying to model the hypothetical relationship between financial development and economic growth, empirical researchers were examining the appropriateness of the different indicators for financial intermediation.

Al-Awad and Harb (2005), this paper investigates the relationship between financial development and economic growth in the middle east countries using methods of panel co-integration and Granger causality, the results indicate that in the long-run term financial development and economic growth may be related to some level, in the short-run term, the panel causality points to real economic growth as the force that drives changes in financial development while individual countries causality fail to give a clear evidence of the direction of causations. Jedidia and all (2014), this paper examined an empirical investigation of whether financial development can boost economic growth in Tunisia, using an Autoregressive Distributed Lag method to assess the finance-growth relation, the empirical results showed that the domestic credit to private sector has a positive effect on the economic growth suggesting that the financial development is a driver of a long term economic growth, but subject to a financial fragility at the short run. Moreover, this study confirmed the view of bidirectional relationship between credit and economic growth. Hassan and al. (2007), provide new evidence on the role of financial development in accounting for economic growth, using an unbalanced panel regressions and variance decomposition to examine what proxy measures are most important in economic growth, the findings suggest that there is a strong linkages between financial development and economic growth in high income OECD countries, but no in South Asian and Sub-Saharan African regions.

3. DATA AND METHODOLOGY

3.1. Data Description

The data we have employed for Algerian economy are annual figures covering the period 1980–2017. Using the auto-regressive distributed lag (ARDL) approach to co-integration analysis proposed by Pesaran and al. (2001). The data was collected from the World Development Indicators (WDI) data base the variables are measured as follows:

(RGDPPC) presents economic growth measured by GDP per capita at 2010 constant prices in US\$ financial development is measured as (PRIV) Domestic credit to private sector (% of GDP), (M2) Broad money (% of GDP) and (INV) Gross capital formation (formerly gross domestic investment) (% of GDP) ; (TRAD) Trade is the sum of exports and imports of goods and services measured as a share of gross domestic product ; and (INF) Inflation as measured by the consumer price index reflects the annual percentage change in the cost to the average consumer of acquiring a basket of goods and services that may be fixed or changed at specified intervals, such as yearly, the Laspeyres formula is generally used.

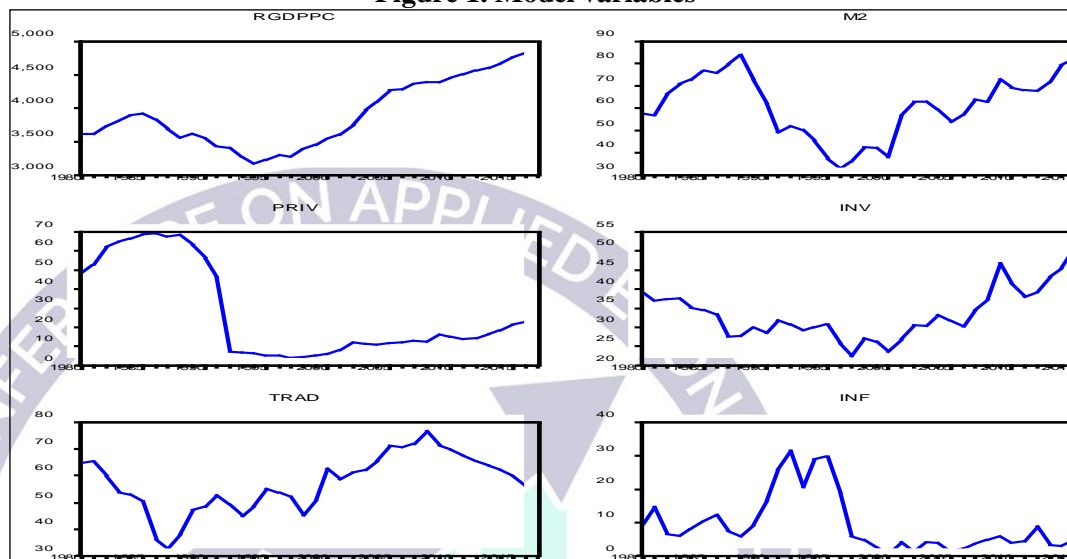
Where RGDPPC is the dependent variable and PRIV, M2, INV,TRAD and INF are the explanatory variables.

3.1.1. Multicollinearity (Correlation Matrix between the independent variables)

Table 1. Multicollinearity

| Covariance Correlation | M2 | PRIV | INV | TRAD | INF |
|---------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|----------------------|
| M2 | 197.9056 1.000000 | | | | |
| PRIV | 184.6856 0.550170 | 569.3961 1.000000 | | | |
| INV | 67.17288 0.657002 | 12.51436 0.072161 | 52.81981 1.000000 | | |
| TRAD | -2.933125 -0.020135 | -112.0010 -0.453287 | 31.74490 0.421827 | 107.2219 1.000000 | |
| INF | -43.64735 -0.377089 | 6.215587 0.031658 | -12.54697 -0.209824 | -34.01536 -0.399253 | 67.69714 1.000000 |

Figure 1. Model variables



It is clear from the graphs of the original time series that there is a fluctuation in these series indicating that they contain a time trend, and therefore may be not stationary at the level, and to study the stationarity of these series are used stationarity tests

3.1.2. Autocorrelation Test « cointegration »

Before performing cointegration test and VEC modeling, we need in first to determine the optimal number of lags, the table shows that the Lag length with the asterisk is one selected by the respective criteria, so you can see that all the criteria choose one (1) lag.

Table 2. Lag selection for the relation between RGDPCC INV M2 PRIV TRAD INF

| Lag | LogL | LR | FPE | AIC | SC | HQ |
|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 0 | -880.8787 | NA | 1.01e+14 | 49.27104 | 49.53496 | 49.36315 |
| 1 | -690.9664 | 305.9698* | 2.01e+10* | 40.72036* | 42.56780* | 41.36516* |
| 2 | -657.2638 | 43.06441 | 2.72e+10 | 40.84799 | 44.27895 | 42.04549 |

* indicates lag order selected by the criterion
 LR: sequential modified LR test statistic (each test at 5% level)
 FPE: Final prediction error
 AIC: Akaike information criterion
 SC: Schwarz information criterion
 HQ: Hannan-Quinn information criterion

3.1.3. Stationarity test « Unite Root Test »

The order of integration of the variables is investigated first. The stationarity tests is performed first in levels and then in first difference to establish the presence of unit roots and the order of integration in all the variables. The results of the Augmented Dickey-Fuller (ADF) stationarity test in the table show that the variables are integrated of order one I(1). It mean that all varibales are stationary in the 1st diffrence.

H₀ (Null Hypothesis): dependent variable has a unit root

Table 3. Augmented Dickey-Fuller (ADF) stationarity test

| Stationarity test | | | | | | | |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | Level | | | 1st difference | | | Decision |
| | Intercept | Trend and Intercept | None | Intercept | Trend and Intercept | None | |
| RGDPC | -0.310791 (0.9135) no | -1.415145 (0.8393) no | 1.088755 (0.9249) no | -3.199938 (0.0282) ** | -3.343116 (0.0756) * | -2.977463 (0.0040) *** | Stationary in I(1) |
| INV | -0.814457 (0.8032) no | -1.806245 (0.6814) no | -0.257773 (0.7554) no | -5.673642 (0.0000) *** | -5.780753 (0.0002) *** | -5.710161 (0.0000) *** | Stationary in I(1) |
| PRIV | -1.495926 (0.5242) no | -1.310812 (0.8691) no | -1.367165 (0.1562) no | -4.245962 (0.0020) *** | -4.280317 (0.0089) *** | -4.266566 (0.0001) *** | Stationary in I(1) |
| M2 | -1.078462 (0.7140) no | -1.151357 (0.9058) no | -0.305649 (0.7689) no | -4.559825 (0.0008) *** | -4.521443 (0.0049) *** | -4.591546 (0.0000) *** | Stationary in I(1) |
| TRAD | -1.523243 (0.5109) no | -3.144206 (0.1119) no | -0.408227 (0.5295) no | -4.757263 (0.0005) *** | -4.740003 (0.0028) *** | -4.825653 (0.0000) *** | Stationary in I(1) |
| INF | -1.829894 (0.3607) no | -2.088382 (0.5350) no | -1.309299 (0.1726) no | -5.536736 (0.0000) *** | -5.45104 (0.0004) *** | -5.606495 (0.0000) *** | Stationary in I(1) |

(*)Significant at 10%; (**)Significant at 5%; (***) Significant at 1% and (no) Not Significant

3.2. Empirical Methodology

This study links economic growth financial development controlling for the influence of, trade openness, investment and inflation. This relationship is given in the long-linear empirical model below:

$$RGDPPC_t = \alpha_0 + \alpha_1 INV_t + \alpha_2 PRIV_t + \alpha_3 TRAD_t + \alpha_4 INF_t + \epsilon_t$$

Where ϵ_t is the error term, RGDPPC represents real GDP per capita for economic growth, M2 and PRIV represent financial development indicators, TRAD is for trade openness; INV is for the rate of investment represented by the ratio of gross fixed capital formation to GDP and INF is for inflation.

The ARDL approach offers some desirable statistical advantages over other co-integration techniques. While other co-integration techniques require all the variables to be integrated of the same order, ARDL test procedure provides valid results whether the variables are I(0) or I(1) or mutually co-integrated and provides very efficient and consistent test results in small and large sample sizes (see Pesaran et al., 2001). The small number of observations and the order of integration make ARDL the preferred approach in this study.

3.2.1. ARDL model

The lag order of model based on Akaike Information Criterion (AIC) is : ARDL(1, 1, 0, 0, 0, 0);

Table 4. The lag order of ARDL model

| Selected Model: ARDL(1, 1, 0, 0, 0, 0) | | | | |
|--|-------------|-----------------------|-------------|----------|
| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Statistic | Prob.* |
| RGDPPC(-1) | 0.768723 | 0.067847 | 11.33027 | 0.0000 |
| M2 | -0.295827 | 2.331806 | -0.126866 | 0.8999 |
| M2(-1) | 2.970776 | 2.057870 | 1.443617 | 0.1596 |
| PRIV | -1.401307 | 0.823633 | -1.701373 | 0.0996 |
| INV | 7.490001 | 3.083295 | 2.429220 | 0.0216 |
| TRAD | 4.451236 | 1.586552 | 2.805603 | 0.0089 |
| INF | -7.404011 | 1.850804 | -4.000429 | 0.0004 |
| C | 362.1498 | 146.2320 | 2.476542 | 0.0193 |
| R-squared | 0.988447 | Mean dependent var | | 3918.773 |
| Adjusted R-squared | 0.985658 | S.D. dependent var | | 513.0719 |
| S.E. of regression | 61.44462 | Akaike info criterion | | 11.26296 |
| Sum squared resid | 109487.8 | Schwarz criterion | | 11.61127 |
| Log likelihood | -200.3648 | Hannan-Quinn criter. | | 11.38575 |
| F-statistic | 354.4430 | Durbin-Watson stat | | 1.907568 |
| Prob(F-statistic) | 0.000000 | | | |

The ARDL model can be specified as:

$$\begin{aligned}
 (RGDPPC)_t = & 362.1498 + 0.7872(RGDPPC)_{t-1} - 0.2958(M2)_t + 2.9708(M2)_{t-1} \\
 & - 1.4013(PRIV)_t + 7.49(INV)_t + 4.4512(TRAD)_t \\
 & - 7.404(INF)_t
 \end{aligned}
 \tag{2}$$

3.2.2. Unrestricted Error Correction Model (UEMC)

Table 5. Error Correction Model

| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Statistic | Prob. |
|----------|-------------|------------|-------------|--------|
| D(M2) | -1.243676 | 2.216510 | -0.561096 | 0.5790 |
| C | 302.6903 | 136.3648 | 2.219709 | 0.0344 |
| M2(-1) | 3.650574 | 2.394262 | 1.524718 | 0.1382 |

| | | | | |
|--------------------|-----------|-----------------------|-----------|----------|
| PRIV(-1) | -1.668663 | 0.878875 | -1.898635 | 0.0676 |
| INV(-1) | 3.919009 | 2.893254 | 1.354533 | 0.1860 |
| TRAD(-1) | 5.547344 | 1.753548 | 3.163497 | 0.0036 |
| INF | -6.418267 | 1.778044 | -3.609735 | 0.0011 |
| RGDPPC(-1) | -0.216075 | 0.073555 | -2.937610 | 0.0064 |
| R-squared | 0.564472 | Mean dependent var | | 32.55338 |
| Adjusted R-squared | 0.459345 | S.D. dependent var | | 88.55873 |
| S.E. of regression | 65.11659 | Akaike info criterion | | 11.37905 |
| Sum squared resid | 122965.0 | Schwarz criterion | | 11.72735 |
| Log likelihood | -202.5124 | Hannan-Quinn criter. | | 11.50184 |
| F-statistic | 5.369406 | Durbin-Watson stat | | 1.998053 |
| Prob(F-statistic) | 0.000506 | | | |

The error correction model for the estimation of the short run relationships is specified as:

$$\Delta(RGDPPC) = 302.6903 - 0.2161(RGDPPC)_{t-1} - 1.2437\Delta(M2)_t + 3.6506(M2)_{t-1} - 1.6687(PRIV)_{t-1} + 3.919(INV)_{t-1} + 5.5473(TRAD)_{t-1} - 6.4183(INF)_t$$

(3)

Where Δ is the difference operator. The test involves conducting F-test for joint significance of the coefficients of lagged variables for the purpose of examining the existence of a long-run relationship among the variables. The null hypothesis of no long-run relationship existing between the variables is examined following Pesaran and al. (2001).

The decision to reject or accept H_0 is based on the following conditions:

If F-value (greater than) > upper bound, then reject H_0 and the variables are co-integrated,

If F-value (lesser than) < lower bound, then accept H_0 and the variables are not co-integrated,

If F-value \geq lower bound and \leq upper bound, then the decision is inconclusive.

4. EMPIRICAL RESULTS

The results in the table below indicate that the F-statistic is greater than the upper critical bound at all significance levels. This study therefore rejects the null hypothesis of no co-integration. This shows that there is a long-run causal relationship among the variables.

4.1. Co-Integration Test

Table 6. ARDL Bounds Test

| Test Statistic | Value | k |
|-----------------------|----------|----------|
| F-statistic | 5.953240 | 5 |
| Critical Value Bounds | | |
| Significance | I0 Bound | I1 Bound |

| | | |
|------|------|------|
| 10% | 2.26 | 3.35 |
| 5% | 2.62 | 3.79 |
| 2.5% | 2.96 | 4.18 |
| 1% | 3.41 | 4.68 |

4.2. Long-Run and Short-Run Estimates

Table 7. Long-run Coefficients

| Long Run Coefficients | | | | |
|-----------------------|-------------|------------|-------------|--------|
| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Statistic | Prob. |
| M2 | 11.565999 | 7.898023 | 1.464417 | 0.1538 |
| PRIV | -6.059000 | 2.980429 | -2.032929 | 0.0513 |
| INV | 32.385417 | 11.867341 | 2.728953 | 0.0107 |
| TRAD | 19.246344 | 7.168397 | 2.684888 | 0.0119 |
| INF | -32.013616 | 9.882864 | -3.239305 | 0.0030 |
| C | 1565.870609 | 440.827010 | 3.552120 | 0.0013 |

The estimated long-run coefficients presented in the table shows that the (M2) broad money who is a coefficient of financial intermediary development is positive and insignificant and (PRIV) domestic credit to private sector is negative and insignificant at 5% significance level, the result shows that (M2) broad money has a big influence on economic growth compared by (PRIV) domestic credit to private sector, its represents about 12% of changes in growth but PRIV represents just 6% of changes in growth. This indicates that financial intermediary development has a positive but insignificant long-run effect on economic growth, suggesting that financial development does not stimulate economic growth in Algeria. The empirical results found that the coefficient of inflation (INF) is negative and significant at 1% level, the coefficient of gross fixed capital (INV) and trade openness (TRAD) are all found to be positive and significant at 5% level, indicating that export of oil and hydrocarbon investment are the long-run driver of economic growth in Algeria. The long-run coefficients in this table create a picture of an economy significantly dominated by activities in the oil sector.

4.3. Short-run error correction estimates

Table 8. Short-Run Error Correction Estimates

| Cointegrating Form | | | | |
|--------------------|-------------|------------|-------------|--------|
| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Statistic | Prob. |
| D(M2) | -0.295827 | 2.331806 | -0.126866 | 0.8999 |
| D(PRIV) | -1.401307 | 0.823633 | -1.701373 | 0.0996 |

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | | | |
|-------------|-----------|----------|-----------|--------|
| D(INV) | 7.490001 | 3.083295 | 2.429220 | 0.0216 |
| D(TRAD) | 4.451236 | 1.586552 | 2.805603 | 0.0089 |
| D(INF) | -7.404011 | 1.850804 | -4.000429 | 0.0004 |
| CointEq(-1) | -0.231277 | 0.067847 | -3.408808 | 0.0019 |

$$\text{Cointeq} = \text{RGDPPC} - (11.5660 * \text{M2} - 6.0590 * \text{PRIV} + 32.3854 * \text{INV} + 19.2463 * \text{TRAD} - 32.0136 * \text{INF} + 1565.8706)$$

The coefficients of the error correction model is negative and highly significant at 1% level, suggesting that short-run disequilibrium is corrected in the long-run equilibrium.

The short-run coefficients of financial intermediary development are negative and insignificant at 5% level. This is because the relationship was very weak, especially for the private sector. It can be explained that the Algerian economy witnessed a marked acceleration in the decline in credit to the private sector beginning in the 1990s, especially after the decline of Algeria's foreign currency incomes after the 1986 oil crisis. The results confirm the dominant role of the oil sector on economic activities in Algeria.

4.4. CUSUM and CUSUMSQ Stability Tests

We also performed the CUSUM and CUSUMSQ stability test for estimated long-run and short-run models based on the estimates of equation.

It can be seen from the figures that the plots of CUSUM and CUSUMSQ statistics are well within critical bounds, implying that all the coefficients in the error correction model are stable.

Figure 2. Plot of Cumulative Sum of Recursive Residuals

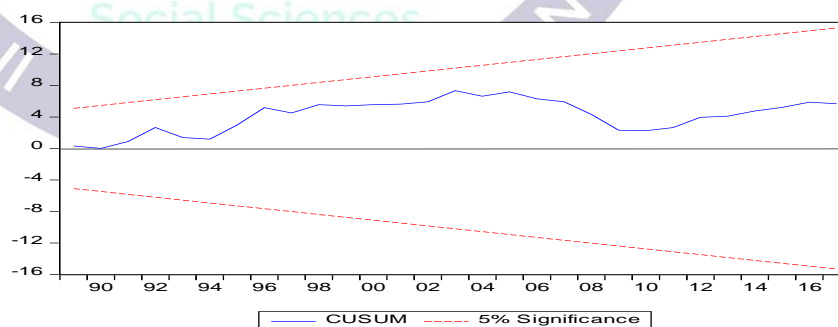
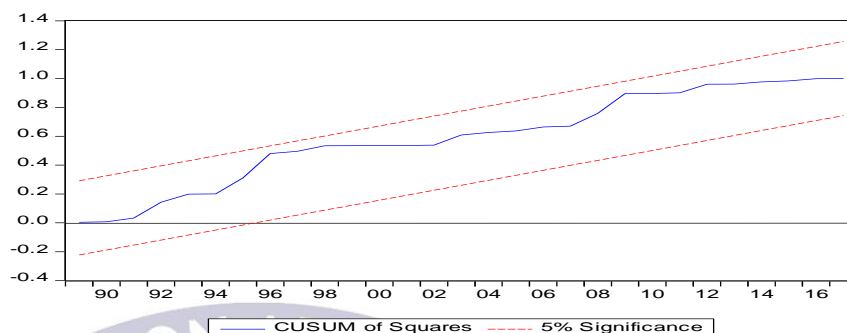


Figure 3. Plot of Cumulative Sum of Squares of Recursive Residuals (CUSUMSQ)



5. CONCLUDING REMARKS

Creating economic conditions in oil-dependent economies that adversely affect the ability of financial intermediaries to allocate resources efficiently. identified these economic conditions to include the general inefficiency of financial institutions, the dominant role of public sector in resource allocation and the weakness of private sector, while the rent-seeking associated with the high revenue from the oil sector drives resources away from institutions that could encourage economic activities in the private sector to the inefficient public sector.

The dominant role of oil price on economic activities calls for urgent need to diversify the Algerian economy. Diversified economies are less exposed to external and fiscal shocks. The development of the financial system could be the right strategy to achieving this objective giving the link between the financial sector and the private sector. Strengthening the intermediary role of financial intermediaries in Algerian economy by building institutional framework that would channel financial resources in the economy to productive investment projects through the financial system could stimulate economic activities in the private sector, lessen the burden on the public sector and the dominance of the oil sector in the economy.

REFERENCES

- Ahmed, S. M., and Ansari, M. I. (1998) "Financial sector development and economic growth: The South-Asian experience", *Journal of Asian Economics*, 9(3): 503-517.
- Al-Awad, M. and Harb, N., (2005) "Financial development and economic growth in the Middle East", *Applied Financial Economics*, 15(15): 1041-1051.
- Bhatia, R.J., and Khatkhate, D. R. (1975). "Financial Intermediation, Savings Mobilization and Entrepreneurial Development: The African Experience", *IMF Staff Papers*, 22: 132-158.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Choong, C. K., and Chan, S. G. (2011) "Financial Development and Economic Growth: A Review", *African Journal of Business Management*, 5(6): 2017-2027.
- Goldsmith, R. W. (1966) "The Determinants of Financial Structure. Paris: The OECD.
- Goldsmith, R. W. (1969) "Financial Structure and Development", New Haven: Yale University Press,
- Gurley, J. G., and Shaw, E. S. (1955) "Financial Aspects of Economic Development", *American Economic Review*, 45: 515-538.
- Hassan, M.K., Sanchez, B. and Yu, J.S., (2011) "Financial development and economic growth: New evidence from panel data", *The Quarterly Review of economics and finance*, 51(1): 88-104.
- Jedidia, K. B., Boujelbène, T., & Helali, K. (2014) "Financial development and economic growth: New evidence from Tunisia", *Journal of Policy Modeling*, 36(5): 883-898.
- Khatkhate, D. R. (1972) "Analytic Basis of the Working of Monetary Policy in Less Developed Countries", *IMF Staff Papers*, 19.
- King, R. G., and Levine, R. (1993a) "Finance and Growth: Schumpeter Might be Right", *Quarterly Journal of Economics*, 108: 717-738.
- King, R. G., and Levine, R. (1993b) "Finance, Entrepreneurship and Growth: Theory and Evidence", *Journal of Monetary Economics*, 32: 515-542.
- Patrick, H. T. (1966) "Financial Development and Economic Growth in Underdeveloped Countries", *Economic Development and Cultural Change*, 34: 174-189.
- Pesaran, M., Shin, Y., Smith, R. (2001) « Bounds testing approaches to the analysis of level relationships ». *J. Appl. Econom.* 16: 289–326.
- Porter, R. C. (1966) "The Promotion of the 'Banking Habitat' and Economic Development", *Journal of Development Studie*

**REKABET AVANTAJI SAĞLAMADA DEĞER ZİNCİRİ ANALİZİNİN SAĞLIK
HİZMETLERİNDEKİ ROLÜ¹**

Fatih ORHAN*

Fırat SEYHAN**

Fatih AYHAN***

ÖZET

İşletmelerde değer oluşturmanın rekabet avantajı elde etme ve bu durumu devam ettirme konusundaki rolü gün geçtikçe daha fazla büyük önem arz etmektedir. İşletmelerin kendi ürünleri veya süreçlerinin etkinliğini arttırmak, buna bağlı olarak da rekabet üstünlüğünü elde etmek için değer yönetimine yönelmiş olmaları bu durumu daha da dikkat çekici ve önemli kılmaktadır. Değer zinciri analizi, stratejik yönetim sürecinde işletmelerin pazarda varlıklarını sürdürebilmeleri, arzu ettikleri nihai sonuca varmaları ve çevresinde oluşan fırsat ve tehditlere karşı izleyecekleri stratejilerin belirlenmesi sürecinde önemli bilgiler ve geniş bir görüş açısı sağlamaktadır. Özellikle sağlık sektöründe, hizmetlerin sunumu sırasında hizmet sağlayıcılar ve hastalar arasında var olan yakın ilişki ve eşzamanlılığın yüksek olması nedeniyle, değer zinciri oldukça sık bir şekilde karşımıza çıkmaktadır.

Bu çalışmada, hizmet sunan sağlık işletmelerinin mevcut pazarda varlığını sürdürebilmesi, rekabet üstünlüğünü elinde bulundurarak kar marjını arttırması ve hastaların bu sağlık kurumunu tercih etmeleri gibi hedefleri gerçekleştirmesinde değer zinciri analizinin rolü ele alınmış ve bu analizin üstünlükleri ortaya konulmaya çalışılmıştır.

Anahtar Kelimeler: Değer Zinciri, Rekabet Avantajı, Sağlık Hizmetleri, Değer Zinciri Analizi

¹ Bu çalışma Bandırma Onyedil Eylül Üniversitesi Bilimsel Araştırma Projeleri Koordinasyon Birimi tarafından BAP-GMYO-1009-126 numaralı proje kapsamında desteklenmiştir

* Dr. Öğr.Gör., Sağlık Bilimleri Üniversitesi, Gülhane SMYO Sağlık Kurumları İşletmeciliği Programı, Ankara, fatih.orhan@sbu.edu.tr

** Uzm., Sağlık Bilimleri Üniversitesi, Gülhane Eğitim ve Araştırma Hastanesi, Ankara, firatseyhan@mynet.com

*** Dr. Öğr. Üyesi, Bandırma Onyedil Eylül Üniversitesi, Gönen MYO, Balıkesir, fayhan@bandirma.edu.tr

**THE ROLE OF VALUE CHAIN ANALYSIS IN HEALTH SERVICES ON COMPETITIVE
ADVANTAGE**

ABSTRACT

The role of value creation in businesses is not only gaining a competitive advantage but also in maintaining the situation is becoming more and more important day by day. It has become even more striking and important that businesses have shifted to value management to increase the effectiveness of their products or processes and, consequently, to gain competitive advantage. Value-chain analysis provides important insights and broad perspectives in the process of strategic management, in which businesses can sustain their presence in the market, determine the final outcome they desire and identify strategies for monitoring opportunities and threats around them. The value chain is often confronted frequently, especially in the healthcare sector because of the high level of close relationship and synchronicity between service providers and patients during the delivery of services. In this study, the role of value chain analysis was discussed and the advantages of this analysis were tried to be elucidated, such as the ability of surviving health services to survive in the current market, to increase profit margins by holding competitive advantage and to make patients prefer this health care facility.

Key Words: *Value Chain, Competitive Advantage, Health Services, Value Chain Analysis*

1.GİRİŞ

Sağlık sektöründe hızla ilerleyen gelişmeleri takip edebilmek kadar bu gelişmeleri sağlık işletmelerine uygulamak da oldukça önemlidir. Burada kuskusuz en önemli unsur hastane yönetimi ve yönetimin stratejik yönetim sürecini uygulama başarısıdır. Türkiye’de son yıllarda kamu kurum ve kuruluşları da dahil stratejik yönetim anlayışlarından önemli artışlar yaşanmaktadır. Hızlı değişim, rekabetçi çevrenin artması, yüksek belirsizlik seviyesi, işletmelerin hızlı bir şekilde bu koşullara sürekli olarak uyum sağlaması ve dinamik strateji geliştirmeye doğru hareket etmesi gerekliliğini ortaya çıkarmıştır (Altıntaş, 2003). Bu gereklilik ise doğrudan işletmeler için stratejik yönetimin öneminin sürekli artmasına yol açmaktadır. Günümüzde tüm işletmeler ürettikleri mal ve hizmetlerde kaliteyi, verimliliği, etkinliği, performansını en temel hedefler olarak görmektedirler. Bunu başarmak için de yeni anlayışlar geliştirilip benimsenmekte ve uygulamaya sokmaktadırlar (Özeri, 2015). İşletmelerin ayakta kalması çalışanların çalışmaya devam edebilmesi, pazardaki rekabete uyum sağlamaya ve kar etmeye bağlıdır.

Hızla değişen çevre koşulları ve işletmenin içinde bulunduğu pazardaki zorlu rekabet ortamında işletmelerin sürdürülebilir bir rekabet avantajı elde etmeleri için, kendi işletmelerinin değer zincirlerini tanımlamalı ve uygulamalıdır. Bu bağlamda işletmeler bahse konu rekabet avantajını elinde bulundurmaları için müşteriye değer yaratmak kavramından hareketle, faaliyetlerinde bu değer yaratılmasına yardım edecek olayları analiz etmek zorundadır.

2. İŞLETMEDE DEĞER YAARATAN FAALİYETLERİN BELİRLENMESİ

Günümüzde işletmelerde değer oluşturma rekabet avantajı elde etmede ve bu durumu devam ettirme konusundaki rolü gün geçtikçe daha fazla büyük önem arz etmeye başlamıştır. Böylece işletmeler, kendi ürünleri veya süreçlerinin etkinliğini arttırmak veya devam ettirmek, buna bağlı olarak da rekabet üstünlüğünü elde etmek için değer yönetimine yönelmiş olmaları bu durumu daha da dikkat çekici ve önemli kılmaktadır. Genel olarak değer, bir müşterinin ödediği fiyat karşılığında elde etmiş olduğu teknik, ekonomik, sosyal faydaların ve hizmetin parasal karşılığıdır (Anderson ve Narus, 1998). Bu durumdan hareketle bahse konu rekabet üstünlüğünü elinde bulundurmaya isteyen işletmeler, ilk olarak müşteriler için değer yaratmanın oldukça önemli bir kriter olduğunu da göz ardı etmemelidir (Beccera, 2009). İşletmeler, eğer bir değer yaratıyorsa bu çevresel bağlılık zinciri ile yapılmaktadır. Bu nedenle işletmeler içsel faaliyetlerini geliştirmenin yanı sıra, değer zincirinde yer alan diğer işletmelerle bağlarını geliştirmek suretiyle karlılıklarını ve durumlarını iyileştirebileceklerdir (Eren, 2000).

2.1. Değer Zinciri Analizi

Günümüzün rekabetçi pazar ortamında işletmeler değer zinciri analizinden yararlanmak durumundadır. Değer zinciri analizi işletmelerin devamlı bir rekabet avantajı elde etmeleri için önemli bilgiler ve geniş bir görüş açısı sağlamaktadır. Bir işletmenin amacının her zaman rekabet avantajı elde etmek olduğu düşünüldüğünde, bunu gerçekleştirmenin bir yolu da müşterilere en iyi değeri sağlarken, işletmenin rekabet avantajı yaratmak için ne yapabileceğini inceleyen değer zinciri analizi yapmaktan geçer. Önemli fırsatların işletme sınırlarının dışında yer aldığı, malzemenin kimin tarafından ve ne şekilde tasarlandığı, nasıl depolandığı, üretim aşamasında hangi hammaddelerin kullanıldığı, nereden tedarik edildiği, nerede işlenip dönüştürüldüğü, dağıtımın hangi kanalları il yapıldığı, tedarikçi ve müşterilerle güçlü bir ilişkinin nasıl sağlandığı, hangi tedarik zinciri yapısının kullanıldığı, son tüketiciden bilginin nasıl elde edildiği, sistemlerin ve bilgi akışının nasıl koordine edildiği ve performansın optimizasyonu için tedarik zinciri unsurları arasında uygulanan teşvik sisteminin nasıl geliştirildiği kritik sorulardır. Bu soruların büyük bir kısmı değer zinciri analizi ile daha kolay anlaşılabilir hale gelebilmektedir (T.C. Ekonomi Bakanlığı, 2013).

İşletmelerde dış çevreden kaynaklanan fırsatlardan yararlanmak ve tehlikeleri kaçınmak isteyen yöneticiler, işletmenin iç çevresindeki güçlü ve zayıf yönlerini analiz etmek için Porter'in değer zinciri analizini etkili bir araç olarak kullanmaktadırlar. Değer zinciri analizi, işletmenin temel amacının artık değer ya da başka bir ifade ile kâr oluşturmak olduğu üzerine kurulmuştur. Değer zinciri, işletmelere bir yandan rekabetçi çevre içerisinde önemli müşterilerin ihtiyaçlarını karşılayabilecek bir bakış açısı sunmakta iken diğer yandan da şirketin değer yaratma sürecinde meydana gelebilecek değişimleri görebilme fırsatı tanımaktadır (Nicovich vd, 2007). Bu bağlamda değer zinciri, mevcut pazarda faaliyet gösteren işletmelerin stratejilerinin belirlenmesi ile işletmenin üstünlük ve zayıflıklarının tespit edilmesinde etkin bir yöntem olarak ortaya çıkmaktadır (Güleş ve Bülbül, 2004).

Değer zinciri işletmelere makro ve mikro olmak üzere iki düzeyde etki etmekte olup bunlardan birincisi, işletmenin faaliyet alanına ait çerçevenin ortaya konulması; ikincisi ise işletmenin kendi bünyesindeki mevcut süreçlerin tanımlanmasıdır. (Rainbird, 2004).

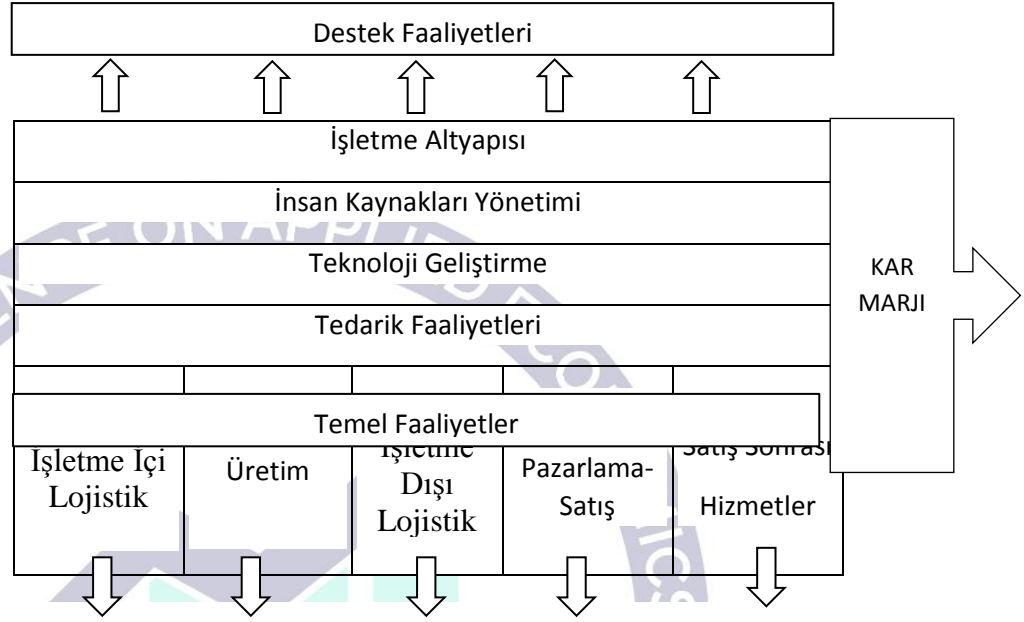
İşletmenin müşterilere katma değer yaratmak üzere gerçekleştirilen bir faaliyetler bütünü olarak ele alındığı düşünüldüğünde değer zinciri analizi, işletmenin faaliyet alanındaki her bir aktivitenin çıktısını değerlendirerek hangi şekilde müşteriye katma değer yarattığını inceleyen bir yaklaşımdır. Bir başka şekilde tanımlamak gerekirse, değer zinciri analizi, maliyet hareketliliğini ve potansiyel olarak başka işletmelerden farklı olmalarını sağlayacak olan unsurları anlamak için işletmenin faaliyetlerini stratejik açıdan ilgili faaliyetlere bölümlendirmek, bu nedenle de kaynakların en etkin şekilde kullanımı için oldukça yararlı olan bir araçtır. (Hwang, 1999).

Değer zincirin haritası hazırlanırken hangi boyutların kullanılacağına belirlenmesi sürecinde birtakım sorular rehberlik etmektedir. Bunlar; Değer zincirinde bulunan temel süreçler nelerdir? Bu temel süreçler ile ilgisi olan aktörler kimlerdir? Değer zincirinde ürün ve bilgi akışları nelerdir? Ürünlerin hacmi nedir? Aktörler ve çalışanların sayısı nedir? Ürün veya hizmet nereden gelmektedir ve nereye gidiyor? Değer zinciri boyunca nasıl değişiyor? Ne tür ilişkiler ve bağlantılar var? Değer zincirini besleyen hizmetler nelerdir? Değer zinciri içinde çeşitli düzeylerdeki anahtar kısıtlamalar ve bu problemlere potansiyel çözümler nelerdir?(T.C. Ekonomi Bakanlığı, 2013). Bu noktadan hareketle bir işletmede yapılan faaliyetler, ürünün tasarımı, üretimi, pazarlama, dağıtım ve satış sonrası hizmetleri ve benzeri işlemlerin toplamı olarak düşünüldüğünde, bu faaliyetlerin iyi şekilde yapılması o işletmenin ürün ya da hizmetlerinin değerini artırır. Ayrıca, bunların başarılı biçimde yapılması rekabet üstünlüğü için gereklidir. Çünkü rekabet üstünlüğü, işletmenin değer oluşturulan fonksiyonlarını rakiplerinden daha ucuz maliyetle yapabilmesine ya da ürünlerinin kalite ve işlevlerini farklılaştırarak yüksek bir fiyat isteyebilmesine bağlıdır. Bu durumdan hareketle bir işletmenin bunları başarabilmesi, değer oluşturan fonksiyonların bir ya da birkaçında rakiplerine oranla rekabet üstünlüğüne sahip olmasına bağlıdır.

Porter tarafından geliştirilen değer zinciri analizi, işletmenin içsel fonksiyonlarının üstünlüğünü ve onlar arasındaki uyumluluğu ve sinerjiyi ilgilendirir(Eren, 2006). Değer zinciri işletmeler tarafından üretilen mamullere ve işletmelerin hizmet alanlarına göre farklılıklar göstermektedir. Örneğin, mal veya hizmetler için tanımlanacak değer zincirleri birbirlerinden farklı olacağı gibi bir tekstil işletmesi ve bir otomobil üreticisi olan işletme için de farklı değer zinciri söz konusu olacaktır. Dolayısıyla, işletmeler kendi değer zincirini tanımlamalıdır. (Dinçer, 2003). İşletmelerin yapmış olduğu faaliyetlerde değer zincirlerine odaklanması oldukça önemli ve işletme açısından yararlı bir unsurdur. Hizmetlerin sunumu sırasında hizmet sağlayıcılar ve hastalar arasında var olan samimiyet ve eşzamanlılığın yüksek olması nedeniyle, özellikle sağlık sektöründe değer zinciri oldukça sık bir şekilde karşımıza çıkmaktadır. Sağlayıcı sistemlerin iç işleyişinin, hastaların ve bu iç işleyişleri ilk elden ele alan diğer kişilerin tutumlarını nasıl etkileyebileceğini görmek de kolaydır(Luke vd., 2004). Bahse konu olan durumları sağlık işletmeleri için düşündüğümüzde değer zinciri, yeni değerler eklenebilecek bir sağlık kuruluşundaki bu alanlara odaklanmak için kullanışlı bir araçtır. Değer zinciri iki ana bileşene ayrılmıştır. Birincisi, sağlık hizmetlerinin sunumuyla ilgilidir ve hizmet öncesi faaliyetler, hizmet noktası faaliyetleri ve servis sonrası faaliyetleri içerir. İkinci ana bileşen, örgüt kültürü, örgüt yapısı ve stratejik kaynakları içeren destek faaliyetlerinden oluşur(Swayne vd., 2006). Bu analizin temeli, sağlık kurumlarının hedeflerine ulaşmak amacıyla faaliyette bulunduğu farklı alanların her birinin değer zincirinin bir halkası olduğu ve kendi kurumlarına birbirinden farklı değerler kattığı anlayışına dayanmaktadır. Dolayısı ile değer zinciri analizini etkin şekilde uygulayan bir sağlık kurumu yöneticisi değer zinciri analizinin her bir halkasındaki faaliyetlerin değerini artırarak kendi kurumunun faaliyet gösterdikleri pazardaki değerini artırabilmekte ve büyük ölçüde rekabet avantajı sağlayabilmektedir(Bilgin ve Uğurluoğlu, 2015). Değer zinciri kavramı; bireysel departmanlar, iş birimleri, şirketler, dikey ortaklıklar ve hatta yerel veya bölgesel sağlık dağıtım sistemlerini içeren geniş ve birbiriyle ilişkili ve çoğunlukla birbirine bağlı çok çeşitli dağıtım birimleri de dahil olmak üzere organizasyonların her seviyesine ve kombinasyonlarına uygulanabilir(Luke vd., 2004).

Değer zinciri analizi Michael Porter tarafından 1985 yılında geliştirilmiş olup, bu faaliyetler yakından incelendiği takdirde temel faaliyetler ve destek faaliyetler olmak üzere iki grupta toplandığı görülecektir. Bu faaliyetler bir ürün veya hizmet üreten bir işletmenin, üretmiş olduğu bu hizmet veya ürünü sunduğu pazar, içinde bulunduğu sektör ve işletmenin destek faaliyetlerinin bir derlenmesi olarak aşağıdaki Şekil 1'de bir süreç halinde görülmektedir.

Şekil 1. Değer Yaratan Faaliyetler ve Değer Zinciri (Porter, 1985)



Yukarıdaki şekilde görüldüğü üzere işletme faaliyetleri iki ana grup altında incelenebilir. Birincisi temel faaliyetlerdir ve bu faaliyetler aşamalı olarak yapılmakta olup bazı aşamalar için daha önceki aşamaların tamamlanması gerekmektedir. Ayrıca bütün bu aşamalar gerçekleşirken bu süreçle aynı anda devam eden destek faaliyetleri vardır ve bu destek faaliyetlerinin sürekli olması oldukça önemli bir unsurdur. İşletmenin gerçekleştirdiği bütün bu faaliyetlerinin sonucunda hedeflenen ise yüksek kar marjıdır.

2.2. Değer Yaratan Temel Faaliyetler

Bir işletmeye gerçek rekabet avantajı getiren, bahse konu işletmenin sahip olduğu temel yetkinliklerdir. Temel yetkinlikler ise müşteri için değer üretme kapasitesine sahip, rakiplerden çok daha başarılı bir biçimde performe edilebilen ve çeşitli yeni ürün ve hizmet üretilmesinde kullanılabilme özelliğine sahip bir dizi teknoloji ve beceri harmanıdır (Hamel ve Prahalad, 1996). Şekil 1'de görülen değer yaratan faaliyetler, temel faaliyetler ve destek faaliyetleri olmak üzere iki genel başlık altında toplanmış olup bu faaliyetlerin içerikleri aşağıda ifade edilmiştir (Kuyucak ve Şengür, 2009). Temel faaliyetler, üretim ile ilgili hammadde tedarik edilmesinden, mal veya hizmetin üretim süreci, ürünün satışı ve müşteriye ulaştırılması ve hatta satış sonrası hizmetleri de içeren faaliyetlerdir. Temel

faaliyetler de kendi içerisinde alt gruplar ayrılmakta olup, bu alt birimler ise; işletme içi lojistik, üretim, işletme dışı lojistik, pazarlama ve satış, satış sonrası hizmetlerdir.

a) İşletme İçi Lojistik: Üretilen mal veya hizmet ile ilgili girdilerin tedarik edilmesi süreci olarak da ifade edilebilen bu faaliyetler; girdilerin satın alımı, sevkiyatı, kabulü, stoklanması ve üretim yerine dağıtılması ile ilgili faaliyetleri içermektedir.

b) Üretim: Girdilerin nihai ürün haline dönüştürülmesindeki bütün üretim faaliyetlerini kapsamaktadır.

c) İşletme Dışı Lojistik: Üretimi tamamlanmış ürünlerin depolanması, sipariş alınması, alınan siparişin gönderime hazır hale getirilmesi, nihai müşteriye ulaştırılması gibi faaliyetleri kapsamaktadır.

d) Pazarlama ve Satış: Fiyatlandırma, dağıtım kanalları seçimi ve ilişkileri, reklam ve promosyon gibi pazarlama faaliyetleri ile bunun yanı sıra satış süreçlerini içermektedir.

e) Satış Sonrası Hizmetler: Satılan ürün ile ilgili pazarda tüketiciler tarafından kabul edilmesini sağlamak, müşteri memnuniyetini ve bu memnuniyetin devam ettirilmesi hedeflenerek satış sonrası kurulum, kullanıcı eğitimleri, tamir, bakım, gibi satış sonrası hizmetlerini içermektedir.

Üretim işletmelerinde üretim süreci kritik önem taşıyan faaliyet olabilirken; ana faaliyet konusu dağıtım olan bir işletme için, içe ve dışa doğru lojistik kritik öneme sahip faaliyetler olabilir (Porter, 1985).

2.3. Destek Faaliyetleri

Destek faaliyetleri, teknoloji, insan kaynakları, genel satın alma gibi temel faaliyetleri destekleyen ve bu sayede işletme için değer yaratılmasına katkıda bulunan işletme içi diğer faaliyetlerden oluşmaktadır. Destek faaliyetlerini de kendi içinde dört gruba ayırmak mümkündür. Bunlar; işletme altyapısı, tedarik faaliyetleri, insan kaynakları yönetimi ve teknoloji geliştirmedir.

a) İşletme Altyapısı: İşletme altyapısı, işletmedeki bütün yönetim fonksiyonları ile, planlama, muhasebe-finans, hukuk ve kalite yönetimi gibi işletmenin tüm değer zincirini desteklemekte olup; büyük öneme sahip rekabet avantajı yaratabilecek bir potansiyele sahiptir.

b) Tedarik Faaliyetleri: Tedarik bir işletmenin değer zincirindeki faaliyetlerde kullanılacak olan girdilerin satın alım işlevidir. Satın alınan girdiler, hammaddeler, gereçler ve diğer tüketilebilir girdiler olduğu gibi; makine, ofis malzemeleri ve binalar gibi varlıklar da olabilir. Ancak buradaki tedarik faaliyetlerinin temel faaliyetler içerisinde sınıflandırdığımız iç ve dış lojistik faaliyetlerinden farkı, temel faaliyetlerde bulunan lojistik faaliyetlerinde ifade edilmek istenen; üretimde kullanılacak olan girdilerin tedariki iken, destek faaliyetlerinde bulunan tedarik faaliyetleri ise esas üretime destek veren

en basit ifadeyle kullanılan bir sarf malzemesinden, bina, makine, teknolojik yatırımlara kadar olan ve destekleyici unsurları kapsayan faaliyetlerdir.

c) İnsan Kaynakları Yönetimi: Değer zincirindeki hem temel hem de destek faaliyetlerini destekleyen insan kaynakları yönetimi, işe alımı, eğitimi, geliştirme ve ücretlendirmesi, performansının değerlendirilmesi, ödüllendirme gibi personel ile ilgili tüm faaliyetlerden oluşmaktadır.

d) Teknoloji Geliştirme: Teknoloji, uzmanlık, yöntemler, süreç ve donanımlar olarak diğer tüm değer zinciri faaliyetleri içerisinde ve ortaya çıkan ürünün kendisinde yer almaktadır. Araştırma geliştirme faaliyetini de içeren teknoloji, rekabetçi avantaj elde etmede önemli olmakla birlikte özellikle bazı endüstrilerde rekabetçi avantajın başlıca kaynağıdır. Tüm işletme işlevlerinin yerine getirilmesinde kullanılan her türlü teknoloji ile tüm bu faaliyetlerin yapılmasında ve uyumlaştırılmasında kullanılan bilgi sistemleri de bu kapsamda değerlendirilebilir ve günümüzde artık önemli bir rekabet avantajı olarak kabul görmektedir.

Değer zinciri faaliyetlerinin, kuruluşun mevcut stratejisini ne derece desteklediğini değerlendirmek özellikle önemlidir. Örneğin, mevcut strateji yüksek kaliteye dayanıyorsa, değer zinciri faaliyetleri yüksek kaliteli ürünlerin oluşturulmasını sağlamak için yapılandırılmalıdır. Öte yandan, eğer işletme büyük oranda fiyat temelinde rekabet ediyorsa, faaliyetler maliyetleri en aza indirecek şekilde düzenlenmelidir (Evans vd., 2003). Gelir yaratan temel faaliyetler ve destek faaliyetleri sağlık kurumlarının da üzerine durduğu önemli hususlardan birisidir. Eğer sağlık işletmesi tarafından rekabetin yoğun yaşandığı sağlık sektöründe rakiplerinden farklı olmak ve böylece rekabet avantajını elinde bulundurmak isteniyorsa yukarıda belirtilen temel ve destek faaliyetleri değerlendirilirken işletme için değer yaratacak şekilde planlanmalı, değer yaratması için de her bir unsurun üretim maliyetlerinin düşürülmesi ya da üretilen mal veya hizmette farklılık yaratabilmesi hususu göz önünde bulundurulmalıdır. Bu faaliyetler esnasında, değer zinciri analizinde maliyet avantajını ve farklılığı ortaya koymak ve her bir faaliyetin pazarda bulunan rakiplerin değer zincirindeki benzer faaliyetleri ile karşılaştırılarak rekabet üstünlüğüne sahip olup olmadığını anlamak açısından oldukça önemlidir. (Porter, 1985). Her işletmenin üretimini gerçekleştirdiği her değer için farklı değer zinciri analizi yapması mümkündür. Örnek olarak bir sağlık kuruluşunda bulunan laboratuvar birimi için farklı bir değer zinciri analizi, radyolojik görüntüleme birimi için farklı bir değer zinciri analizi ya da hizmet sunucuları tarafından verilen poliklinik hizmetleri için farklı bir değer zinciri analizi üretmek söz konusudur. Her birim kendi tedariki, kendi ürettiği hizmet veya ürünleri kendi pazarlama satış ve satış sonrası hizmetlerine göre değerlendirilir. Örneğin bir hastane için hizmet mal üretiminden sonra müşteriye bu hizmet veya malın sevk edilmesi söz konusu olmayabilir. Veya hizmet üretimi sırasında farklı değerlendirme aşamaları (muayene, laboratuvar, ameliyat gibi) bulunabilir. Bu değer zincirlerinin

gerekli görüldüğü aşamalarda gerekli seviyeye indirilmesinde analizin derinleştirilmesi açısından fayda vardır(Şeker, 2014).

3. DİĞER SEKTÖRLERDE DEĞER ZİNCİRİ ANALİZİ

Değer zinciri, işletmelerin kendi değer zincirlerinin öncesinde, sonrasında ya da aynı paralellikte yer alan diğer değer zincirleri incelenerek işletmenin olası dikey ve yatay bütünleşme fırsatlarını değerlendirebilmesi açısından büyük önem arz etmektedir (Shank ve Govindarajan, 1992). Her ne kadar değer zinciri modeli, üretim işletmeleri için geliştirilmiş olsa da hizmet işletmeleri kendi süreçlerini göz önüne alarak bu modelden yararlı çıkarımlar yapabilirler (Buhalis, 2003).

Tekstil Sektörü: Türkiye’de tekstil ve hazır giyim sektöründe değer zincirine yönelik çalışmalar Türk tekstil ve konfeksiyon sanayinin rekabet gücü odaklıdır ve çalışmalarda değer zincirinin analizi ile birlikte uluslararası rekabet gücünü yükseltecek şekilde geliştirilmesi üzerinde de durulmaktadır (Atılğan, 2006). Tekstil ve hazır giyim sektöründe değer zinciri hammadde veya üretimden (pamuğun toplanması veya yeni sentetik iplik geliştirilmesi gibi) başlamakta ve birincil imalattan sonra iplik veya kumaşın ortaya çıktığı standart mamül üretimine geçmektedir. Bu noktada yeni ürün geliştirme, patentler ve teknoloji değer sunmada etkili olmaktadır. Bir sonraki aşamayı ise ürünün pazarlanması, dağıtım ağları ile nihai tüketiciye sunulması oluşturmaktadır. Bu süreç içerisinde firmanın strateji geliştirerek, rekabet gücünü yükselttiği aşama değer zincirindeki en önemli operasyon alanını oluşturmaktadır (Eraslan ve Ark., 2008).

Havayolu Sektörü: Hava taşımacılığı insan ve yüklerin havadan taşınarak sağladığı yer ve zaman faydası ile değer yaratmaktadır. Havayolları, taşıma faaliyetinin gerçekleşmesi için havaalanları, hava trafik hizmet birimleri, uçak üreticileri ve bakım işletmeleri gibi endüstride yer alan diğer elemanlarla ilişki içerisinde. Süreçte yer alan tüm elemanlar arasındaki bağlantılar ve eşgüdüm hava taşımacılığı endüstrinin değer zincirini oluşturmaktadır. Bu değer zinciri sonucunda ortaya çıkan değer, son kullanıcıya sunulan emniyetli ve etkin hava taşımacılığı faaliyetidir (Kuyucak ve Şengür, 2009).

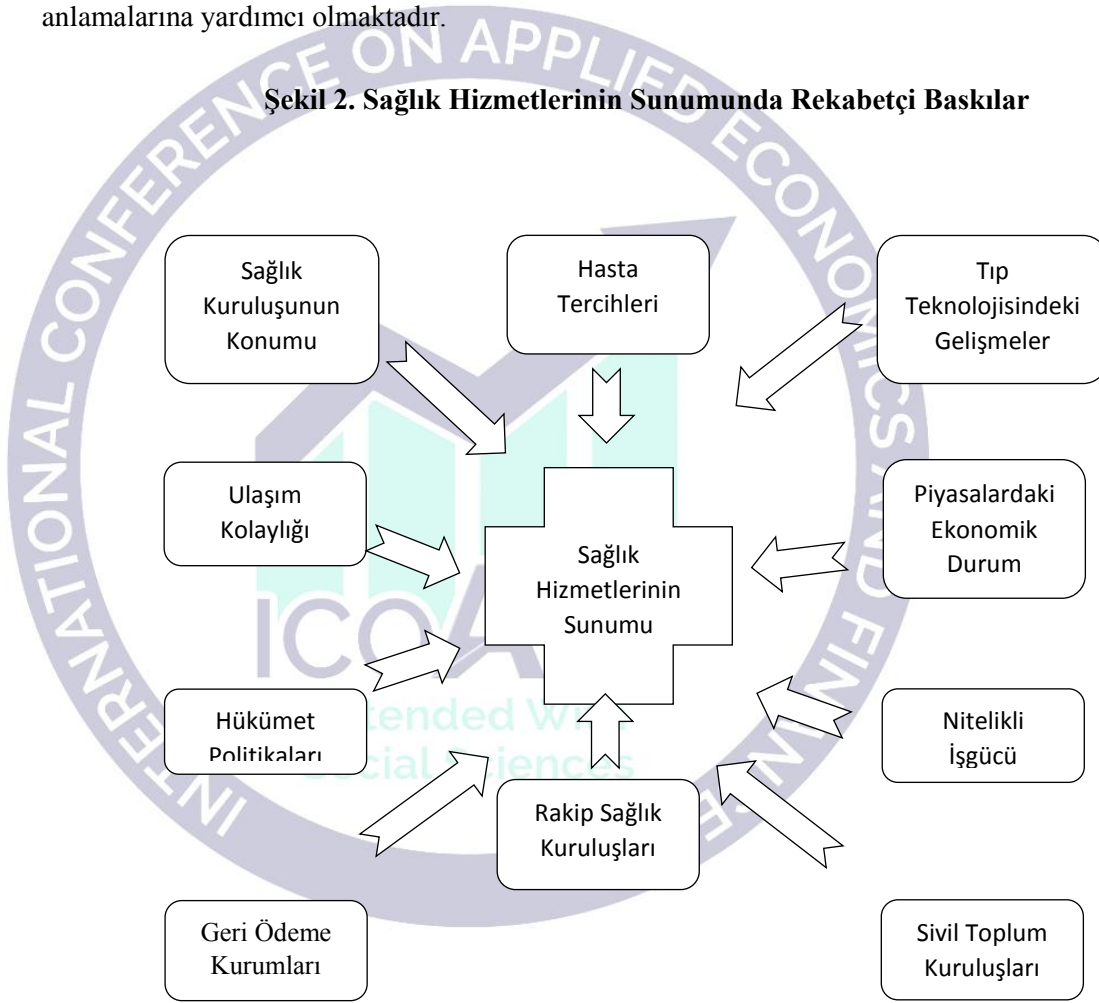
Gıda Sektörü: Gıda sektöründe değer zincirlerinin şekillenmesinde iki faktör büyük önem arz etmekte olup bunlar zincirin belirli noktalarında yoğunlaşma sonucu ortaya çıkan asimetrik güç ilişkileri ve standartların artan önemidir. Gelişmekte olan ülkelerde artan gelir nedeniyle katma değeri yüksek gıda ürünlerine talep hızla artarken, gelişmiş ülkelerde farklılaştırılmış, gıda güvenliği sağlanmış kaliteli ürünlere talep artmaktadır. Kentleşme, kadının çalışma yaşamına artan katılımı, yükselen gelirler, zamanın azalması “parası bol, zamanı kıt” bir kitlenin ortaya çıkmasına neden olmuş, hazır gıdalara yönelimi arttırmıştır. Turizm, yabancı işçiler gibi faktörler gıdalarda çeşitliliğin artmasını teşvik

etmiştir. Tüketiciler, gıdaların her mevsim bulunabilmesini istemekte; salgın hastalıklar nedeniyle gıda güvenliğine artan bir önem vererek izlenebilirlik talep etmektedirler (Alemdar, 2008).

4. SAĞLIK HİZMETLERİNDE DEĞER ZİNCİRİ ANALİZİNİN ROLÜ

Değer zinciri analizi, esas itibariyle işletmelerin pazardaki mevcut konumunun belirlenmesi açısından önemli olmasının yanı sıra, işletmelerin rekabet üstünlüğü sağlayabilmeleri açısından rakiplerinin ve kendilerinin birer parçası olduğu, birbirine eklenmiş birçok faaliyetler bütünü anlamalarına yardımcı olmaktadır.

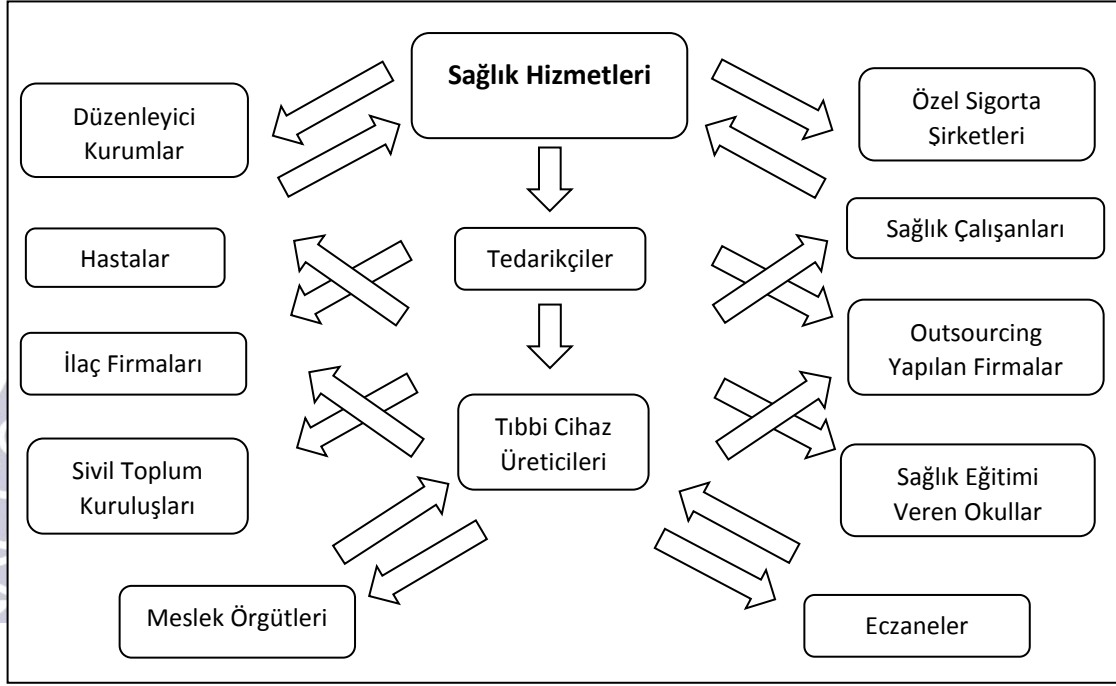
Şekil 2. Sağlık Hizmetlerinin Sunumunda Rekabetçi Baskılar



Bir örgütün rekabet üstünlüğü, değer zincirinde yer alan önemli operasyonları rakiplerinden daha iyi yapma becerisinden kaynaklanmaktadır (Eraslan ve ark., 2008). Bununla birlikte, stratejik analiz için de oldukça gerekli olduğu düşünülen değer zinciri analizi, dış kaynak kullanımı, yatay ya da dikey bütünleşme/ayırılma, kıyaslama ve stratejik işbirlikleri kararları için önemli girdilerin elde edilmesini sağlamaktadır. (Shank ve Govindarajan, 1992). Son zamanlarda sağlık yöneticileri, birbiri ile ilintili

hizmetler yumağından oluşan sağlık sektöründe sadece yapısal kararlarla uğraşmanın yeterli olmadığını, çeşitli stratejiler belirleyerek bu konulara odaklanmanın gerekliliğinin farkına varmışlardır (Li, 2002).

Şekil 3. Sağlık Hizmetlerindeki Farklı Faaliyet ve Bağlantı Türleri



Sağlık hizmetlerindeki farklı faaliyet ve bağlantı türlerinin hepsini kapsayacak şekilde değer zinciri analizinin yapılması, bahse konu sağlık işletmesinin mevcut pazarda varlığını sürdürmesini sağladığı gibi aynı zamanda rekabet avantajını da elinde bulundurarak rakiplerine karşı üstünlük kurmasını da sağlayacaktır.

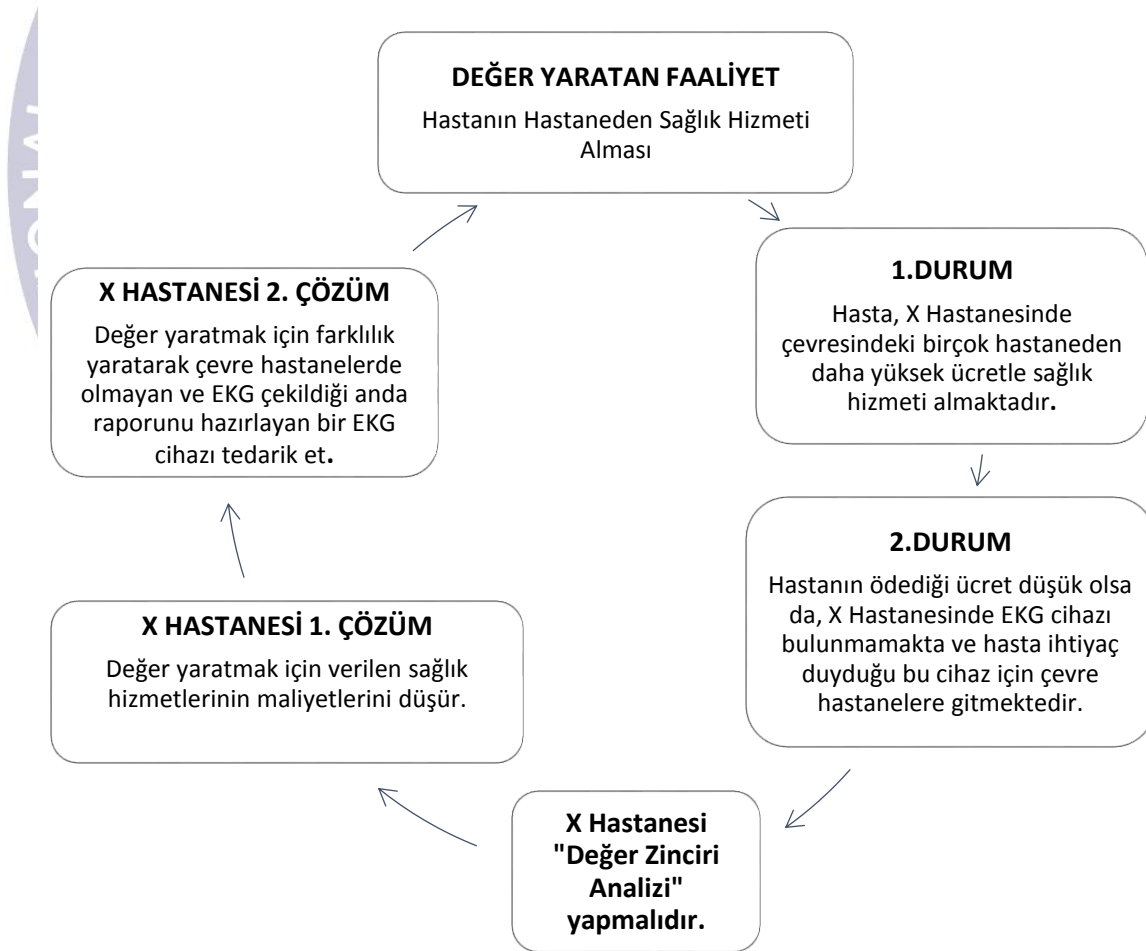
Gün geçtikçe artan küresel rekabet ortamında yer alan sağlık işletmeleri bir yandan giderek artan maliyet baskısı diğer bir yandan da hastaların istek ve ihtiyaçlarındaki değişimi anlama ve bu değişime değer yaratarak cevap verme eğilimindedirler. Değerin yaratılıp, yaratılmadığı müşterinin satın aldığı mal ve hizmeti algılaması sonucu ortaya çıkar. Ayrıca değer zincirinde, değeri belirleyen iki unsur bulunmaktadır. Bunlar; değer yaratan faaliyetlerin toplam maliyeti ve bu faaliyetlerin sonucu elde edilen toplam gelirdir. Toplam gelir ile toplam maliyet arasındaki fark işletmenin kâr marjını oluşturmaktadır. Eğer bir işletmede maliyetler elde edilen gelirlerden yüksek ise, o işletmede değer yaratmayan faaliyetlerle uğraşılıyor anlamına gelmekte ve işletme tarafından pazarda var olmak ve rekabet avantajını elinde bulundurmak isteniyorsa bu faaliyetleri terk etmek zorunda olduğu bilinmektedir. Görüldüğü üzere işletmeler ortaya çıkan ve hedeflenen bu marjı büyütme amacıyla rekabet üstünlüğü

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

elde etmeye çalışırlar. Değer zinciri analizinde bulunan temel faaliyetler ve destek faaliyetleri birbiriyle ilişki içinde bulunduğundan, bir faaliyette maliyetleri etkileyebilecek veya farklılık doğurabilecek bir olay, zincirdeki diğer faaliyetleri de aynı şekilde etkileyebilmektedir (Ülgen ve Mirze, 2014). Bu durumu sağlık kurumları için örneklendirmek gerekirse; bir hastanenin radyoloji birimine, eski ve aktif olarak çalışan bir MR cihazına ek olarak, birçok teknolojik fonksiyona sahip yeni bir MR cihazı tedarik edilmiş olması, temel faaliyetlerin maliyetlerini arttırabilmektedir. Ancak bu durum, yeni bir cihaz alımı ile birlikte eski olan cihaza harcanmakta olan bakım-onarım maliyetlerinin azalmasına neden olmakta, yani değer zinciri analizindeki hizmet sonrası servis ve bakım-onarım faaliyetlerini dolaylı olarak etkilemekte, hastaneye değer yaratmış olmakta böylece hastanenin rekabet üstünlüğü kazanmasında destekleyici bir rol oynamaktadır.

Şekil 4. Bir Sağlık Kuruluşunda Değer Yaratılması Örneği



Yukarıdaki şekil 4’de görüldüğü üzere değer yaratan faaliyet, hastanın X Hastanesi’nden satın aldığı sağlık hizmetini algılaması sonucu ortaya çıkmaktadır. Hastanın bu hizmet sonucunda bir sonraki sağlık hizmetine ihtiyacı olduğunda tekrar X Hastanesi’ni tercih etmesi için iki durumla karşılaşması gerekmektedir. Bunlardan birincisi standart bir sağlık hizmetini az bir maliyetle satın aldığına inanması, bir diğeri ise ödediği sağlık hizmeti ücreti yüksek dahi olsa satın aldığı bu hizmetin çevredeki birçok hastanede bulunmaması nedeniyle farklılık taşıdığına inanmamasıdır. Eğer hasta X Hastanesi’nde bu iki durumla da karşılaşmamışsa bunun sonucu olarak bu iki unsurdan en az birini taşıyan bir başka hastaneyi tercih edecektir. Bu durumda X Hastanesi, rekabet üstünlüğünü elinde bulundurmak ve hastanenin kar marjını arttırmak için değer zinciri analizi yapmalı, yani değer yaratmak için iç verimlilik çalışmaları ile verilen sağlık hizmetlerinin maliyetlerini düşürmeli ya da değer yaratmak için farklılık yaratarak çevre hastanelerde olmayan ve hastaların kendi hastanelerini tercih etmesini sağlayacak farklı teknolojiye sahip bir EKG cihazı tedarik etmeli böylelikle hem kar marjını arttırmalı hem de mevcut sağlık hizmetleri pazarında rekabet üstünlüğünü elinde bulundurmalıdır.

KAYNAKÇA

- Alemdar, T.,(2008) “Küresel Değer Zincirleri İçerisinde Türk Gıda Sektörünün Konumu”, 8. Ulusal Tarım Ekonomisi Kongresi Bildirileri , Vol. Gıda İ.: 35-45.
- Altıntaş, F.. (2003) “Strateji Geliştirme Süreci İçerisinde Stratejik Başarı Unsurlarının Değerlendirilmesi”, ISGUC The Journal of Industrial Relations and Human Resources.
- Atılgan, T., (2006), “Tekstil ve Hazır Giyim Sektöründe Değer Zinciri ve Ekonomik Etkileri”, Tekstil ve Konfeksiyon Dergisi, Ocak-Mart.
- Anderson, J.C., Narus,J.A., (1998) “Business Marketing: Understand What Customers Value”, Harvard Business Review.
- Beccera, M., (2009) “Theory of the Firm for Strategic Management”, Cambridge University Press.
- Bilgin, D.İ. ve Uğurluoğlu Ö., (2015) “Sağlık Kurumlarında Stratejik Yönetim Araçları”, Hacettepe Sağlık İdaresi Dergisi 18(2).
- Buhalis, D.,(2003), “ETourism”, Financial Times Prentice Hall, 376 s., Harlow, İngiltere.
- Dinçer, Ö., (2003) “Stratejik Yönetim ve İşletme Politikası”, İstanbul: Beta Yayınevi, Altıncı Baskı.
- Eraslan, İ.H., Helvacıoğlu Kuyucu A.D., Bakan, İ., (2008) “Değer Zinciri (Value Chan) Yöntemi İle Türk Tekstil Ve Hazır giyim Sektörünün Değerlendirilmesi”, Afyon Kocatepe Üniversitesi, İ.İ.B.F. Dergisi, 10 (2).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Eren, E., (2000) “Stratejik Yönetim ve İşletme Politikası” İstanbul: Beta Yayınevi, Beşinci Baskı.

Eren, E., (2006) “Stratejik Yönetim”, Eskişehir: Anadolu Üniversitesi Yayınları.

Güleş, H.K., Bülbül, H., (2004) “Yenilikçilik: İşletmeler İçin Stratejik Rekabet Aracı”, Nobel Yayınları, Ankara.

Hamel, G., Prahalad, C.K., (1996) “Geleceği Kazanmak”, Çev:Zülfü Dicleli, İnkılap Kitabevi, İstanbul, 261- 266.

Hwang, N., Richard, C., (1999) “Value Chain Cost Tracing and Cost System Obsolescence: An Exploratory Study of Small to Medium Sized Companies”, Journal of Applied Business Research, 15(4).

Li LX, Benton WC, Keong Leong G, (2002) “Technical note: The impact of strategic operations management decisions on community hospital performance”, Journal of Operations Management. 20: 389–408.

Luke, R.D., Waltson, S.L., Plummer, P.M., (2004) “Healthcare Strategy in Pursuit of Competitive Advantage”, Aupa-Hup Publisher.

Nicovich, S.G., Dibrell, C. C., Davis, P.S., (2007) “Intergration of Value Chain Position and Porter’s (1980) Competitive Strategies into the Market Orientation Conversation: An Examination of Upstream and Downstream Activities”, The Journal of Business and Economic Studies, 13(2): 91-108.

Özeri, M.A., (2015) “İşletmelerde Stratejinin Önemi Üzerine Değerlendirmeler”, Uluslararası İktisadi ve İdari İncelemeler Dergisi, Year:7 Number 14, ISSN 1307-9832.

Porter, M.E., (1985) “Competitive Advantage: Creating and Sustaining Superior Performance”, New York: The Free Press.

Shank, J.K.ve Govindarajan, V., (1992) “Strategic Cost Management: The Value Chain Perspective,” Journal of Management Accounting Research, Fall, 179-197.

T.C.ekonomi Bakanlığı İhracat Genel Müdürlüğü, (2013) “Kümeler İçin Değer Zinciri Yönetimi Klavuzu”.

Ülgen, H., Mirze, K., (2014) “İşletmelerde Stratejik Yönetim”, 7.Baskı, İstanbul: Beta Yayıncılık.

**SUKUK İHRACININ HİSSE SENEDİ GETİRİLERİNE ETKİSİ: ÖRNEK BANKA
ÜZERİNDE BİR OLAY ÇALIŞMASI**

Gamze GÖÇMEN YAĞCILAR*

Zühal ARSLAN**

ÖZET

İslami finansın son yıllardaki en önemli araçlarından biri olan; varlığa dayalı, istikrarlı gelir sağlayan, ikincil piyasada işlem gören ve İslami prensiplere uygun orta vadeli sertifikalar olarak tanımlanan Sukuk son yıllarda gelişmekte ve faizsiz finans anlayışını benimseyen yatırımcılar için uygun araç olarak kabul edilmektedir. Bu çalışmanın amacı da örnek bir katılım bankasının (Albaraka Türk) 2017 yılı içerisinde ilan ettiği Sukuk ihraçlarının, hisse getirileri üzerinde bir etkisinin olup olmadığını araştırmaktır. Çalışmada “Olay Çalışması” yöntemi kullanılmıştır. Albaraka Türk bankasının 2017 yılı içerisinde farklı tarihlerde gerçekleştirdiği Sukuk ihraçlarına dayanılarak 6 olay tespit edilmiştir. Elde edilen bulgular, olay gününün öncesinde ve sonrasında anlamlı anormal getiriler elde edilebileceği, fakat bu durumun tüm olaylar için geçerli olmadığı, ayrıca anormal getirilerin ortaya çıkış zamanının da tutarlı olmadığı bulunmuştur. Ayrıca CAAR değerlerinin anlamlı bulunmaması, çalışmanın diğer bir bulgusudur.

Anahtar Kelimeler: Sukuk, Faizsiz Finansal Araçlar, Kira Sertifikaları, Anormal Getiriler, Olay Çalışması.

JEL Kodları: G14, G21, G23.

**IMPACT OF ISSUING SUKUK ON STOCK RETURNS EVENT STUDY OF A SAMPLE
BANK**

ABSTRACT

One of the most important tools of Islamic finance in recent years; Sukuk, defined as asset-based, stable income, traded in the secondary market and defined as medium-term certificates in accordance with

* Dr. Öğr. Üyesi Süleyman Demirel Üniversitesi, İİBF, Bankacılık ve Finans Bölümü, Isparta, Türkiye, gamzeyagcilar@sdu.edu.tr

** Arş. Gör. Isparta Uygulamalı Bilimler Üniversitesi, YUBYO, Bankacılık ve Sigortacılık Bölümü, Isparta, Türkiye, zuhalkucukcakal@sdu.edu.tr

Islamic principles, is considered as a suitable tool for investors who have developed in recent years and adopted the concept of interest-free finance. The objective of the present study is to gain an understanding of whether the issuing of Sukuk has an impact on stock returns of a sample participation bank (Albaraka Türk) announced in 2017. The “Event Study” method was employed in the research. A total of six events were identified based on Sukuk that was issued in different dates by Albaraka Türk bank in 2017. The results indicate that it is possible to gain abnormal returns before and after the event, although this situation was not valid for all events, and the occurrence time of the events was not consistent either. Another finding of the study is that the CAAR values were not significant.

Keywords: *Sukuk, Non-Interest Financial Instrument, Rental Certificates, Abnormal Returns, Event Study.*

JEL Codes: *G14, G21, G23.*

1.GİRİŞ

Dünya ekonomisinin büyümesi ve teknolojik ilerlemeyle birlikte finansal varlıklarla ilgilenen yatırımcı kitlesi genişlemiş, ihtiyaçlar çeşitlenmiş ve bu ihtiyaçları karşılamaya yönelik farklı araçlar geliştirilmeye başlanmıştır. Bu bağlamda, geleneksel finansal piyasalardan inançları gereği uzak duran yatırımcı kesiminin ihtiyaçlarına cevap verecek ürünlerin tasarlanması gereği doğmuştur. Ülkemizde “kira sertifikası” adıyla ihraç edilen SÜKUK, sözü edilen alternatiflerden biridir. İhraççı kuruluşlar için faize dayalı borçlanma araçlarının alternatifi olarak görülebilecek SÜKUK’ların ihracı, 2010 yılından itibaren yaygınlaşmaya başlamıştır ve son yıllarda özellikle katılım bankalarının fon sağlamada sıkça başvurdukları bir yöntem haline gelmiştir.

Sukuk dar ve geniş olmak üzere iki farklı şekilde tanımlanmaktadır. Dar tanıma göre sukuk, varlığa dayalı, istikrarlı gelir sağlayan, ikincil piyasada işlem gören ve islami prensiplere uygun orta vadeli sertifikalar olarak tanımlanmaktadır. (Yakar, Kandır ve Önal, 2013:74). Daha Geniş tanıma göre ise sukuk, belirli yatırım faaliyetlerine, belirli projelere duran varlıklara, kullanım haklarına sahipliği temsil eden eşit değerde ve bölünemeyen da bir projede ya da özel bir yatırım faaliyetinde ortaklık hakkı veren sertifikalar olarak tanımlanmaktadır (Ayub, 2007, s.392).

Sukuk geleneksel bono ve hisse senetlerinden birkaç noktada farklılaşmaktadır. Sukukun özellikle bono ve hisse senetleriyle ayrıntılı olarak karşılaştırılması Tablo 1’de gösterilmiştir.

Tablo 1. Sukuk, Bono ve Hisse Senetlerinin Karşılaştırılması

| | Sukuk | Bono | Hisse Senedi |
|--|---|--|--|
| İhraç Konusu | Borç senedi değildir. Belirlenmiş varlık ya da proje üzerinde bölünmemiş sahiplik hakkı söz konusudur. | İhraç edenin borcu söz konusudur | Şirketin hissesinden sahiplik hakkı söz konusudur. |
| Varlığa Dayalı Olma Durumu | En az belirlenen oran nispetinde maddi varlık olmalıdır.(%51-sukuku icara için) | Genellikle gerekli değildir. | Gerekli değildir. |
| Teminat | Dayandığı varlıklar ya da proje üzerindeki sahiplik hakkı ile teminat sağlamaya ek olarak teminat artırımı ile de teminat sağlar. | İpotekli tahviller, teminatlı borç senetleri vb. dışında genellikle teminat içermezler | Teminat içermezler |
| Anapara ve Gelir | İhraççı tarafından garanti edilmemiştir. | İhraççı tarafından garanti edilmiştir. | Şirket tarafından garanti edilmemiştir. |
| Amaç | Sadece İslam hukukuna uygun amaçlar için ihraç edilebilir. | Her türlü amaç için ihraç edilebilir. | Her türlü amaca uygundur. |
| Senetlerin Satılması | Belirlenmiş varlık ya da proje üzerindeki sermaye payının satışı söz konusudur | Bir borç senedinin satışı söz konusudur. | Şirketin hisselerinin satışı söz konusudur. |
| Senet Hamillerinin Sorumlulukları | İhraç edilen senetlere katılım oranında dayalı olduğu varlık/ teşebbüse bağlı olarak tanımlanmış bir sorumluluk söz konusudur. | Bono sahiplerinin mali durumunu için herhangi bir sorumluluğu yoktur. | Sahip olunan şirket hisseleri oranında şirketin işlerinden sorumluluk söz konusudur. |

Kaynak: Adam ve Thomas, 2004:54. Aktaran: Aslan,2012:58; Yılmaz,2014:84

İslami finans araçlarının en yaygın olanlarından kabul edilen Sukuk, günümüzde uluslar arası boyutta pek çok piyasada kendine yer bulmaktadır. Sukuk ihracı Küresel düzeyde 2000’li yıllardan itibaren yapılmakta iken Türk sermaye piyasası mevzuatında, SPK’nın Nisan 2010 tarihinde yayınlanan Seri:III, No:43 sayılı "Kira Sertifikalarına ve Varlık Kiralama Şirketlerine İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ" ile yer almıştır (SPK,2010). İlk sukuk ihracı, 01.04.2010 tarih ve 27539 sayılı Resmi Gazetede yayımlanarak yürürlüğe giren bu tebliğe dayanılarak 2010 yılında gerçekleştirilmiştir (Alpaslan ve Kudun, 2016:320).

Türkiye Katılım Bankaları Birliği verilerine göre Türkiye’de sukuk ihracı amacıyla kurulan Albaraka Türk VKŞ, Türkiye Finans VKŞ, Kuveyt Türk VKŞ ve Aktif Bank VKŞ’ye ilave olarak Vakıf Katılım ve Ziraat Katılım ile beraber toplamda altı şirket mevcuttur. Ayrıca Türkiye Cumhuriyeti Hazine Müsteşarlığı da sukuk ihracı yapabilmektedir.

Sukuk sistemine ayrıntılı bakılacak olursa bu sistemde aşağıda belirtildiği üzere temel olarak üç taraf vardır (Tok, 2009:16):

Dayanak varlığın sahibi olan kuruluş (Originator/yükümlü): Kamu kurum ve kuruluşları, belediyeler, özel ve kamu sektöründe faaliyet gösteren varlık sahipleri vs.

Özel amaçlı kurum (Special purpose vehicle/SPV) : Sukuk ihracını gerçekleştiren ve yükümlü ile sukuk alıcıları ve müşterileri arasında eşgüdümü sağlayan şirkettir.

Sukuk sahipleri (Investors/Yatırımcılar): İhraçtan sukuk sertifikası alan yatırımcılar.

Uygulamada en fazla icare sukukuyla karşılaşılmaktadır. İcare sukuku sistemin işleyişi ise şu şekildedir (Kasımoğlu, Yetgin ve Küçükçolak, 2018:22):

- (1) Yüklenici, dayanak varlığı üzerinde mutabık kalınan fiyattan ve belirlenen vade sonunda geri alma şartıyla SPV’ye satışını gerçekleştirir.
- (2) SPV, satış fiyatını karşılayacak şekilde sukuk ihracını gerçekleştirir ve satış bedelini yükleniciye öder.
- (3) Yüklenici ile SPV arasında belirli süreli bir kira sözleşmesi yapılır ve yüklenici dayanak varlığın kiracısı durumuna girer.
- (4) Yüklenici SPV’ye düzenli olarak kira bedeli öder.
- (5) Sukuk yatırımcılarına yatırım payları oranında belirlenen dönemlerde SPV tarafından ödemeler yapılır.
- (6) Vade bitiminde SPV dayanak varlığı önceden anlaşılan bedelden yükleniciye geri satışını gerçekleştirir. Bu satıştan elde ettiği tutarı SPV, sukuk yatırımcılarına anapara olarak öder.

Sukuk ihracının Türkiye’de ‘ki gelişimi Katılım Bankaları Birliğinden alınan verilere göre sırasıyla Tablo 2, 3, 4, 5, ’de gösterilmiştir. Türkiye’de Katılım Bankalarının 01.01.2010- 17.10.2010 tarihleri arasındaki sukuk ihraçları Tablo 2’de belirtilmiştir. Tabloya göre tarihler kapsamında sukuk ihracı yurtiçi 30,842 milyon TL ve yurtdışı \$4,276 şeklinde gerçekleşmiştir.

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Tablo 2. 01.01.2010 - 17.10.2018 Katılım Bankalarının Sukuk İhraçları (Milyon TL)

| Yurtiçi (TL) | Yurtdışı (USD) |
|--------------|----------------|
| 30,842 | \$4,276 |

*Katılım bankalarının iştiraki olan varlık kiralama şirketleri üzerinden ihraç edilen "1.589 Milyon TL" tutarındaki ihraçlar hesaplamalara dahil edilmiştir.

Kaynak: <http://www.tkbb.org.tr/diger-istatistikler>

Tablo 3'de ise 01.01.2012 - 17.10.2018 tarihleri arasında Hazine Sukuk İhraçları aşağıda gösterildiği şekliyle gerçekleşmiştir.

Tablo 3. 01.01.2012 - 17.10.2018 Hazine Sukuk İhraçları (Milyon TL)

| Yurtiçi (TL) | Yurtdışı (USD) |
|--------------|----------------|
| 26,055 | \$6,000 |

Kaynak: <http://www.tkbb.org.tr/diger-istatistikler>

Toplam sukuk ihracı ise Tablo 4'de belirtildiği gibi 01.01.2012 - 17.10.2018 tarihleri arası yurtiçi 56,897 milyon TL ve yurtdışı \$10,276 olarak gerçekleşmiştir.

Tablo 4. Toplam Sukuk İhracı (Milyon TL)

| Yurtiçi (TL) | Yurtdışı (USD) |
|--------------|----------------|
| 56,897 | \$10,276 |

*MYR cinsinden yapılan yurtdışı ihraçları için ihraç tarihlerindeki MYR/DOLAR kurları baz alınarak çevrilmiştir.

*Türkiye'de, Hazine ve katılım bankalarının varlık kiralama şirketleri tarafından 2010'dan bugüne 85 Milyar TL'lik sukuk ihracı yapılmıştır.

Kaynak: <http://www.tkbb.org.tr/diger-istatistikler>

Tablo 5'de 01.01.2010- 12.10.2018 tarihleri arası Katılım Bankalarının sukuk ihraçları ayrıntılı olarak verilmiştir. Tabloya göre 01.01.2010- 12.10.2018 tarihleri arasında en yüksek tutarda ihraç gerçekleştiren bankanın Kuveyt Türk Katılım Bankası A.Ş. olduğu, ikinci sırada Türkiye Finans Katılım Bankası A.Ş.'nin yer aldığı, üçüncü sırada Vakıf Katılım Bankası A.Ş., dördüncü sırada çalışma kapsamında analize dahil edilen Albaraka Türk Katılım Bankası A.Ş ve son sırada Ziraat Katılım Bankası A.Ş.'nin yer aldığı görülmektedir. Asya Katılım Bankası A.Ş ise 2016 yılında kapatılmıştır.

Tablo 5. 01.01.2010- 12.10.2018 Katılım Bankalarının Sukuk İhraçları

| BANKALAR | İHRAÇ MİKTARLARI (TRY) | İHRAÇ MİKTARLARI (USD) | TL CİNSİNDEN TOPLAM İHRAÇ TUTARI |
|---|------------------------|------------------------|----------------------------------|
| ALBARAKA TÜRK KATILIM BANKASI A.Ş. | 3,350,000,000 | \$890,000,000 | 5,561,581,000 |
| ASYA KATILIM BANKASI A.Ş. (2010 - 2016) | 654,230,824 | \$0 | 654,230,824 |
| KUVEYT TÜRK KATILIM BANKASI A.Ş. | 10,654,704,800 | \$2,036,704,000 | 15,551,889,800 |
| TÜRKİYE FİNANS KATILIM BANKASI A.Ş. | 6,395,600,000 | \$1,349,113,800 | 9,147,227,000 |
| VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş. | 6,098,994,047 | \$0 | 6,098,994,047 |
| ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş. | 3,689,000,000 | \$0 | 3,689,000,000 |
| TOPLAM İHRAÇ TUTARI* | 30,842,529,671 | \$4,275,817,800 | 40,702,922,671 |

*Katılım bankalarının iştiraki olan varlık kiralama şirketleri üzerinden ihraç edilen "1.588.510.000 TL" tutarındaki ihraçlar hesaplamalara dahil edilmiştir.

Kaynak: <http://www.tkbb.org.tr/diger-istatistikler>

2.LİTERATÜR

Sukukla ilgili geçmişten günümüze uluslararası literatürde birçok çalışma gerçekleştirilmiştir. Bu çalışmalardan bazılarında aşağıda yer verilmiştir.

Çakır ve Raei (2007) çalışmalarında risk-değerli VaR (Riske Maruz Değer) kullanarak sukuk portföyünün risk analizini yapmışlardır. Bu riski hesaplamak adına iki portföy oluşturmuşlardır. İlki, geleneksel tahvilleri oluştururken ikincisi tahviller artı sukuktan oluşmaktadır. Çalışma sonucunda ikinci portföy VaR' sinin ilkinden daha düşük olduğunu ve portföydeki sukuk bütünleşmesinin, çeşitlilik kazanımı sağladığı sonucuna varılmıştır.

Wilson (2008) çalışmasında sukuk ve konvansiyonel tahvillerin kazanç ve getirilerini karşılaştırmıştır. Çalışma sonucunda sukuk yapılarının, konvansiyonel tahvillerin getiri ve kazançlarını benzediğini öne sürmüştür.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Vishwanath ve Azmi (2009), sukuk analizi ve klasik tahvillerle karşılaştırma yaptıkları çalışmalarında sukukun fonları harekete geçirip likidite ve varlık dayanaklarını yönetmek açısından en iyi araç olduğunu böylelikle de sukuk yatırımlarının daha güvenli olduğu fikrini ortaya atmışlardır.

Ramasamy, Munisamy ve Mohd Helmi (2011) Malezya sermaye piyasasında sukuk riskini araştırmışlardır. Sukukun konvansiyonel tahvillerden daha iyi bir duyarlılığa sahip olduğunu ayrıca, sukukun, tahvillerden daha az risk taşıdığını ve yatırımcıların devlet tahvillerine kıyasla daha yüksek, tahvillerden de daha az getiri elde edebildiğini tespit etmişlerdir.

Ariff ve Safari (2012) çalışmalarında aynı performans ve derecelendirmeyle sukuk ve konvansiyonel bankaların arasındaki neden sonuç ilişkisini inceleyerek sukuk performansı üzerinde çalışmışlar ve sukuk performansı ve konvansiyonel tahviller arasında hiçbir sebep sonuç ilişkisi bulunmadığı sonucuna varmışlardır.

Rusgianto ve Ahmad (2013) yaptıkları çalışmalarında Dow Jones Citigroup Sukuk Endeksindeki dalgalanmayı incelemişlerdir. Sonuç olarak finansal krizlerle ilişkili yapısal şokların, sukuk stok endekslerinin davranışını önemli ölçüde etkilediğini, ayrıca sukuk dalgalanmalarının, kötü haberlerden ziyade iyi haberlerden etkilendiğini vurgulamışlardır.

Godlewski, Turk-Ariss, ve Weill (2013), Malezya'daki şirketlerin sukuk ve tahvil ihraç ilanlarına menkul kıymetler borsasının verdiği tepkileri, olay çalışması yöntemi kullanılarak karşılaştırmışlardır. Menkul kıymetler borsası, tahvil ilanlarına olan tepkisinin nötr olduğunu ve yatırımcıların sukuk ilanlarına yönelik tepkisinin olumsuz olduğunu tespit etmişlerdir. Çalışma kapsamında sukuk ilanlarına yönelik olumsuz çıkarımları iki sebebe bağlamışlardır. Bunlardan birincisi, düşük getiri beklentisi olan borç alıcılarının, kar ve zarar paylaşımlı sukuk yapılarının ihracını konvansiyonel faizli tahvillere tercih edeceğinden, ters seçim mekanizması olabileceği; ikincisi ise islami kurumlardan gelen aşırı bir sukuk talebi olabileceğidir. Sukuk ihraç etmenin şirketin tahvil ihraç edemediği durumlarda bir fonlama yöntemi olarak yorumlanabileceğini de vurgulamışlardır.

Fathurahman ve Fitriati (2013) Endonezya bağlamında sukuk ve konvansiyonel tahvilleri getiri bakımından analiz etmiş ve sukuk performansını incelemişlerdir. Sonuç olarak sukuk getirileri ile klasik tahvil getirilerinin önemli ölçüde birbirinden farklı olduğunu tespit etmişlerdir.

Alam, Hassan ve Haque (2013) çalışmalarında sukuk ve konvansiyonel tahvil ilanları ile analiz gerçekleştirmişler ve sonuç olarak 2007 finansal krizinden önce ve kriz boyunca sukuk ilanlarına piyasa tepkilerinin olumsuz olduğunu tespit etmişlerdir.

Azmat, Skully ve Brown (2014) yaptıkları çalışmalarında belirli bir sukuk türünü diğer bir sukuk türüne tercih etmede belirleyici faktörleri araştırmışlardır. Ortaklık sukukunu, icare (finansal kiralama)

ve murabaha (maliyet artı satış) sukukundan ayrı tutmuşlar ve 2002'den 2010'a kadar Malezya sukuk piyasasını ele almışlardır. Sonuç olarak ortaklık sukukunu, öz sermaye aracı olarak değerlendirileceğini düşünmüş olsalar da firmaların, ortaklık sukukunu öz sermaye kaynaklı sebeplerden değil, borç fonlamasına yönelik olarak kullandıklarını tespit etmişlerdir.

El Mosaid ve Boutti (2014) çalışmalarında sukuk portföyünün performansını araştırmışlardır. Bu amaçla, Malezya sermaye piyasalarında sukuk ve konvansiyonel stok endeksleri serileri arasında bir kıyaslama yapmışlardır. Araştırma sonuçlarına göre sukuk portföyleri ile konvansiyonel tahviller arasında olumlu bir korelasyon olduğunu tespit etmişler ayrıca, sukuk stok endekslerinin performansının, geleneksel muadillerine kıyasla kayda değer şekilde yüksek olduğunu da eklemiştir.

Klein, Weill ve Godlewski (2015) konvansiyonel tahviller yerine sukuku tercih eden firma sayısının artma sebebini araştırmışlardır. Çalışmalarında bilgi asimetrisi (firmaların gelecekte beklenenleri belirsizdir ve firmalar zararlarını paylaşmak isterler) ve ters seçim (daha riskli ve daha az kar elde eden firmalar) sonucuna varmışlardır.

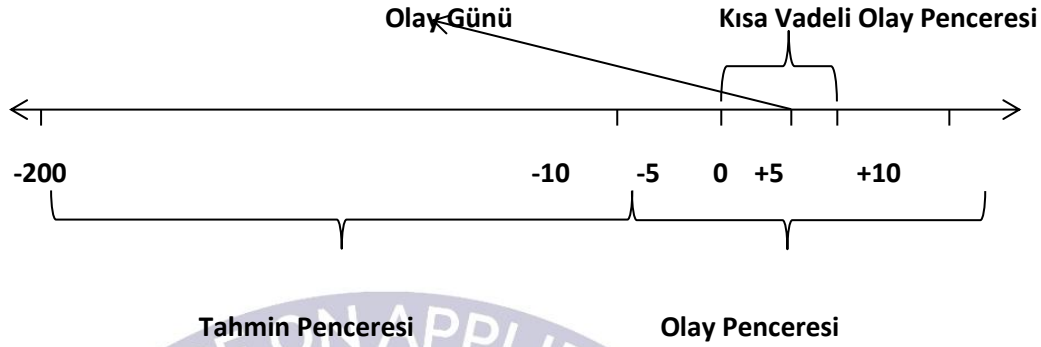
Hassan, Paltrinieri, Dreassi, Miani ve Scip (2018), çok değişkenli GARCH modelini kullanarak gerçekleştirdikleri çalışmalarında, sukuk ve konvansiyonel yatırım notlu tahvillerin, piyasa şoklarına karşı koşullu dalgalanma tepki oranlarının daha düşükken; dayanıklılığının daha yüksek olduğunu tespit etmişlerdir. Ayrıca sukuk getirilerinin ABD ve AB yatırım notlu tahvillerine kıyasla daha az dalgalanma yaşadığı sonucuna varmışlardır.

3. VERİ SETİ VE METODOLOJİ

Sukuk ihracının hisse senedi getirilerine etkisini olay analizi (event study) yöntemi ile tespit etmek amacıyla gerçekleştirilen bu çalışmada 2017 yılında Albaraka Türk Katılım Bankası A.Ş. tarafından 31.03.2017, 11.05.2017, 23.06.2017, 16.08.2017, 26.09.2017, 16.11.2017 tarihlerinde gerçekleştirilen sukuk ihraçlarının bankanın hisse senedi getirisine etkisi incelenmiştir. Veriler Türkiye Katılım Bankaları Birliğinden ve Borsa İstanbul'dan alınmıştır

Çalışmada "Olay Çalışması" yöntemi kullanılmıştır. Bu yöntem, belirli bir olayın (Sukuk ihracı) duyurulması ile piyasada hisse senetlerinin fiyatlarında beklenenin dışında (anormal) bir hareket oluşup oluşmadığını test etmeye yarar. Olayın gerçekleşmesini takiben hisse senedi getirisi beklenen getiriden farklılaşıyorsa, "anormal getiri" oluşmuş demektir ve olayın hisse senedi fiyatını etkilediği şeklinde yorumlanabilir.

Şekil 1. Olay Penceresi



Şekil 1’de görüldüğü üzere sukuk ihraçlarının kamuya açıklandığı tarih, olay zamanı olarak kabul edilmiş, +10-10 günlük olan penceresi içerisinde hisse senedinin getirisinde olaya bağlı bir etkinin var olup olmadığı araştırılmıştır. Etkinin, olaya bağlı olduğu kabul edildiğinde, muhtemel anormal getirilerin duyurudan sonraki günlerde ortaya çıkması gerekir. Ancak bilginin kamuya açıklanmasından önce dışarıya sızmış olabileceği ihtimali de dikkate alınarak, olay zamanının 10 gün öncesi de incelemeye alınmıştır. Olay penceresinden önceki 200 işlem günü ise beklenen getirinin hesaplanmasında kullanılan piyasa modelinin uygulandığı “tahmin penceresi” olarak değerlendirilmiştir.

Bu kapsamda olay çalışmasının gerçekleştirilmesi için en sık tercih edilen yaklaşım piyasa modeli olup gerçekleştirilecek adımlar aşağıda gösterilmektedir (Brown ve Warner, 1985: 1-31; Benninga, 2008:373-374; Mazgit, 2013: 225-264; Yazgan, 2017:60-61).

1. Adım: Hisse Senedi Getirilerinin Hesaplanması

$$R_{it} = \frac{[D + (P_{it} - P_{it-1})]}{P_{it-1}} \quad (1)$$

Denklem (1)’de R_{it} hisse “i” senedinin t günündeki fiili getirisini; P_{it} firmanın hisse senedinin t günü kapanış fiyatını, P_{it-1} “i” hisse senedinin (t-1) günü kapanış fiyatını ve “D” ise hisse senedinin (t) gününde ödenen kar payını göstermektedir. Pazar getiri oranı ise aşağıdaki gibi hesaplanır:

2. Adım: Pazar Getirisinin Hesaplanması

$$R_{mt} = \frac{I_t - I_{(t-1)}}{I_{(t-1)}} \quad (2)$$

Eşitlikteki R_{mt} , pazara ilişkin günlük getiriyi, “ I_t ” BİST100 endeksinin (t) günündeki kapanış değerini, “ I_{t-1} ” BİST 100 endeksinin (t-1) günündeki kapanış değerini göstermektedir. Daha sonra, tahmin penceresindeki ilgili hisse senedi/varlık ve piyasa endeksi üzerinden hesaplanan günlük getiri verileri kullanılarak en küçük kareler yöntemi (EKK) ile α (sabit terim) ve β katsayıları (eğim) hesaplanmıştır. Kullanılan piyasa modeli Denklem (3)’de gösterilmiştir.

3. Adım: Piyasa Modelinin Uygulanması

$$R_t = \alpha_t + \beta_t * R_{m,t} \quad (3)$$

Denklem (3)’de R_t , t gününde gerçekleşen getiriyi, $R_{m,t}$ t gününde gerçekleşen piyasa getirisini, hesaplanan α değeri sabit terimi, β ise sistematik riski göstermektedir.

Hesaplamalar yapıldıktan sonra olay penceresinde gerçekleşen getiriler ve piyasa modeli ile elde edilen katsayılar kullanılarak olay penceresindeki her bir gün için beklenen getiriler denklem (4), anormal getiriler denklem (5) ve kümülatif anormal getiriler denklem (7) hesaplanmaktadır:

4. Adım: Beklenen Getirilerin Hesaplanması

$$E(R)_t = \alpha_t + \beta_t * R_{m,t} \quad (4)$$

Burada;

$E(R)_t$: t günündeki beklenen getiri

α_t : Tahmin penceresinde hesaplanan sabit terim

β_t : Tahmin penceresinde hesaplanan eğim (beta katsayısı)

$R_{m,t}$: t günündeki piyasa getirisi

Anormal getiri (AR) olay penceresindeki her bir gün için cari getiri (R) ile denklem (4)'de hesaplanan beklenen getiri (E(R)) arasındaki farktır:

5. Adım: Anormal Getirilerin (AR) Hesaplanması

$$AR_t = R_t - E(R)_t \quad (5)$$

Anormal getirilerin anlamlılığını test etmek için t istatistiğinden yararlanılmaktadır. T istatistiğinin değeri, günlük anormal getirilerin, piyasa modelinden elde edilen standart hataya bölünmesi suretiyle hesaplanmaktadır. Denklem 6’da t istatistiğinin hesaplanması yer almaktadır.

6. Adım: AR İçin Test İstatistiğinin Hesaplanması

$$t_{istatistiği} = \frac{AR_t}{\sigma} \quad (6)$$

Kümülatif anormal getiri (CAR), bir olayın olay penceresi olarak da ifade edilen belirli bir zaman aralığındaki toplam etkisini göstermektedir. CAR, cari dönemdeki anormal getiri ile bir önceki dönemde hesaplanan CAR toplamına eşittir (Denklem (7)). CAR piyasanın şokları nasıl tanımladığını belirlemek ve endekste dalgalanmaya yol açan belirsizliğin seyrini görmek açısından da değerlendirilmektedir. İlk gün için CAR için aynı günün anormal getirisi olarak alınmaktadır (Yazgan, 2017:61).

7. Adım: Kümülatif Anormal Getirilerin Hesaplanması

$$CAR_t = AR_t + CAR_{t-1} \quad (7)$$

CAAR_t ise olay penceresindeki her bir gün için firmaların AR_t değerlerinin kümülatif toplamı olarak ifade etmektedir. CAAR için t istatistiğinin değeri ise denklem (8)'deki gibi hesaplanmaktadır. Hesaplanan anormal getirilerin anlamlılığı t istatistiğine bakılarak değerlendirilir. Buna göre t istatistiğinin ±1,96 üzerinde olması bulgunun %5 anlamlılık düzeyinde, ±1,64 üzerinde olması ise %10 anlamlılık düzeyinde istatistiksel olarak anlamlı olduğu şeklinde yorumlanır.

T Testi, kümülatif anormal getirilerin homojen dağıldığı, normal dağılıma sahip olduğu, anormal getiriler arasında korelasyon olmadığı ve anormal getirilerin sabit varyansa sahip olduğu varsayımına dayanmaktadır. Bu varsayımlar altında kümülatif anormal getirilerin sıfırdan farklı olup olmadığını belirlemek için kullanılan test istatistiği Denklem 8 ve 9'a göre hesaplanmaktadır (Babacan, 2015:69-70) .

8. Adım: CAAR İçin T İstatistiğinin Değerinin Hesaplanması

$$T_{cross} = \frac{CAAR(T_1;T_2)}{\sigma_{CAAR_{T_1;T_2}}} \quad (8)$$

$$\sigma_{CAAR_{T_1;T_2}} = \sqrt{\frac{1}{N(N-d)} \sum_{i=1}^N [CAR_i(T_1;T_2) - CAAR_i(T_1;T_2)]^2} \quad (9)$$

Denklem 8 ve 9'da yer alan "CAR" kümülatif anormal getirileri, "CAAR" ortalama kümülatif anormal getirileri, "T1;T2" olay penceresini, "N" haber sayısını, "d" serbestlik derecesini tanımlamaktadır. Piyasa modeli için serbestlik derecesi d =2'dir.

4.BULGULAR

Çalışma kapsamında Albaraka Türk bankasının 2017 yılı içerisinde farklı tarihlerde gerçekleştirdiği Sukuk ihraçlarına dayanılarak 6 olay tespit edilmiştir. Olay çalışması yöntemi izlenerek, her bir olayın olay penceresi içerisindeki anormal getiriler ve t istatistikleri hesaplanmıştır ve analiz sonuçları Tablo 6'da gösterildiği şekilde gerçekleşmiştir.

Tablo 6. Tüm Örneklem için Anormal Getiriler

| Olay Zamanı | 16.11.2017 | 26.09.2017 | 16.08.2017 | 23.06.2017 | 11.05.2017 | 31.03.2017 |
|-------------|----------------|----------------|----------------|---------------|---------------|------------|
| -10 | -0.0070 | 0.0157 | 0.0255 | -0.0074 | 0.0023 | -0.0009 |
| -9 | -0.0042 | 0.0133 | 0.0160 | -0.0034 | 0.0036 | -0.0025 |
| -8 | -0.0180 | -0.0074 | -0.0104 | 0.0018 | 0.0309 | 0.0123 |
| -7 | -0.0034 | 0.0033 | -0.0023 | -0.0021 | -0.0119 | 0.0003 |
| -6 | -0.0051 | -0.0186 | -0.0119 | -0.0075 | 0.0061 | 0.0100 |
| -5 | -0.0134 | 0.0044 | -0.0063 | 0.0130 | 0.0012 | -0.0045 |
| -4 | 0.0091 | -0.0031 | 0.0072 | -0.0010 | 0.0006 | -0.0007 |
| -3 | -0.0072 | -0.0115 | -0.0001 | -0.0143 | 0.0022 | -0.0033 |
| -2 | -0.0079 | 0.0060 | -0.0264 | -0.0082 | -0.0053 | 0.0097 |
| -1 | 0.0081 | -0.0149 | -0.0008 | 0.0109 | -0.0153 | 0.0012 |
| 0 | 0.0056 | 0.0093 | -0.0064 | 0.0120 | 0.0034 | 0.0044 |
| 1 | -0.0030 | 0.0054 | 0.0077 | -0.0151 | 0.0023 | 0.0122 |
| 2 | -0.0008 | -0.0037 | -0.0096 | 0.0041 | 0.0037 | -0.0065 |
| 3 | 0.0000 | 0.0051 | -0.0034 | -0.0014 | -0.0125 | -0.0028 |
| 4 | -0.0129 | -0.0219 | 0.0218 | 0.0235 | -0.0029 | -0.0029 |
| 5 | 0.0070 | 0.0072 | 0.0046 | 0.0180 | -0.0015 | 0.0029 |
| 6 | 0.0039 | -0.0049 | 0.0057 | -0.0030 | -0.0026 | 0.0072 |
| 7 | 0.0079 | -0.0058 | -0.0247 | -0.0134 | -0.0032 | -0.0038 |
| 8 | -0.0069 | -0.0059 | 0.0100 | 0.0204 | -0.0044 | 0.0008 |
| 9 | -0.0103 | -0.0013 | 0.0273 | 0.0000 | 0.0069 | -0.0134 |
| 10 | 0.0251 | 0.0064 | 0.0034 | -0.0012 | 0.0029 | 0.0079 |

| | | | | | | |
|------------------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|
| intercept | -0.0006 | 0.0002 | -0.0003 | -0.0007 | -0.0012 | -0.0012 |
| slope | 0.7230 | 0.7565 | 0.8226 | 0.8156 | 0.9283 | 0.8366 |
| steyx | 0.0107 | 0.0106 | 0.0099 | 0.0100 | 0.0106 | 0.0112 |

Tablo 6'a göre (-10+10) günlük olay penceresinde, 16.11.2017 tarihli sukuk ihracı, -10. ve +10. günlerde; 26.09.2017 tarihli sukuk ihracı -6. ve +4. günlerde; 16.08.2017 tarihli sukuk ihracı -2., +4., +7. ve +9. günlerde; 23.06.2017 tarihli sukuk ihracı +4., +5. ve +8. günlerde; 11.05.2017 tarihli sukuk ihracı ise -8.günde anlamlı anormal getirilere neden olmuştur. 31.03.2017 tarihli sukuk ihracı anlamlı bir anormal getiri yaratmamıştır.

Bir olayın olay penceresi olarak da ifade edilen belirli bir zaman aralığındaki toplam etkisini gösteren kümülatif ortalama anormal getirilerin ise tüm örneklem için sonuçları Tablo 7'de belirtilmiştir.

Tablo 7. Tüm Örneklem için Kümülatif Ortalama Anormal Getiriler

| Olay Penceresi | CAAR | t istatistiği |
|-----------------------|-------------|----------------------|
| (-10;+10) | 0.0051 | 0.0124 |
| (-5;+5) | -0.0029 | 0.0113 |
| (-2;+2) | -0.0030 | 0.0086 |
| (-1;+10) | 0.0122 | 0.0159 |

Tablo 7'de görüldüğü üzere tüm örneklem için kümülatif ortalama anormal getirilerin (CAAR) , (-10+10), (-5+5), (-2+2) ve (-1+10) günlük olay pencerelerinde hesaplanan değerlerinin anlamlı olmadığı sonucuna varılmıştır.

5.SONUÇ

Son yıllarda ulusal ve uluslararası piyasalarda sukuk önemli bir finansal araç haline gelmiş ve işlem hacmindeki yükseliş sebebiyle önemini gittikçe artırmaktadır. Sukuk ihracının şirketlere fon yaratmada gittikçe önemli bir araç olmasından yola çıkılan bu çalışmada, Albaraka Türk Katılım Bankasının 2017 yılı içerisinde gerçekleştirdiği sukuk ihracı duyurularının hisse senetlerine ilişkin anormal getirilere yol açıp açmadığı değerlendirilmiştir. Çalışmada olay analizi yöntemi kullanılmıştır. Çalışma kapsamında yapılan analizler sonucunda olay günün öncesinde ve sonrasında anlamlı anormal getiriler elde edilebileceği, fakat bu durumun tüm olaylar için geçerli olmadığı, ayrıca anormal getirilerin ortaya çıkış zamanının da tutarlı olmadığı bulunmuştur. Araştırma kapsamındaki bir diğer önemlibulgu ise kümülatif ortalama anormal getiri (CAAR) değerlerinin anlamlı bulunmamasıdır.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Çalışmanın farklı bankaların yanı sıra farklı yılların sukuk ihraçları da hesaba katılarak genişletilmesi, elde edilen sonuçların kapsamlı bir genellemeye konu olmasına imkân verebilecektir.

KAYNAKÇA

Adam, N.J. ve Thomas, A. (2004) "Islamic Bonds", 1st Edition, London: Euromoney Books

Alam, N., Hassan, M.K. ve Haque, M.A. (2013) "Are Islamic Bonds Different From Conventional Bonds?International Evidence From Capital Market Tests", Borsa Istanbul Review, 13(3):22-29.

Alpaslan, H.İ. ve Kudun, C. (2016) "Türkiye'de Sukuk Uygulamaları ve Vergisel Boyutu",Batman Üniversitesi Yaşam Bilimleri Dergisi, 6(2):319-337.

Ariff, M. ve Safari, M. (2012) "Are Sukuk Securities The Same As Conventional Bonds?", Afro Eurasian Studies, 1(1):101-125.

Aslan, H. (2012) "Alternatif Bir Yatırım ve Finansman Aracı Olarak Sukuk: Yapısı, İşleyişi ve Türkiye Piyasası İçin Öneriler", Yüksek Lisans Tezi, Marmara Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İşletme Anabilim Dalı, Finansal Piyasalar Ve Yatırım Yönetimi Bilim Dalı, İstanbul.

Ayub, M. (2007) "Understanding Islamic Finance", John Wiley & Sons ,Ltd: England.

Azmat, S., Skully,M. ve Brown, K. (2014) "Issuer's Choice Of Islamic Bond Type",Pacific-Basin Finance Journal, 28:122–135.

Babacan, B. (2015) "Gönüllü Açıklamalar Ve Hisse Senedi Fiyat Hareketleri:Bıst'de Bir Uygulama ", Gebze Teknik Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, Doktora Tezi. Gebze.

Benninga, S. (2008) "Financial Modeling. (Third Edition)", London: The Mit Press.

Brown, S.J. ve Warner, J.B. (1985) "Using Daily Stock Returns: The Case Of Event Studies", Journal Of Financial Economics, 14:3-31.

Çakır, S. ve Raei F. (2007) "Sukuk Vs. Eurobonds: Is There A Difference İn Value-At-Risk?", International Monetary Fund, Working Paper, No.Wp/07/237.

El Mosaid, F. ve Boutti, R. (2014) "Sukuk And Bond Performance İn Malaysia", International Journal Of Economics And Finance, 6(2):226- 234.

Fathurahman, H. ve Fitriati, R. (2013) "Comparative Analysis Of Return On Sukuk And Conventional Bonds", American Journal Of Economics, 3(3):159-163.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Godlewski, C. J., Turk-Ariss, R. ve Weill, L. (2013) "Sukuk Vs. Conventional Bonds: A Stock Market Perspective".*Journal Of Comparative Economics*, 41:745–761.

Hassan, M.K., Paltrinieri, A., Dreassi, A., Miani, S. ve Scip, A. (2018) "The Determinants Of Co-Movement Dynamics Between Sukuk And Conventional Bonds", *The Quarterly Review Of Economics And Finance* ,68:73-84.

[Http://Www.Tkbb.Org.Tr](http://Www.Tkbb.Org.Tr).(15.12.2018)

[Http://Www.Tkbb.Org.Tr/Diger-Istatistikler](http://Www.Tkbb.Org.Tr/Diger-Istatistikler). (15.12.2018)

Kasimoğlu, M., Yetgin, F. ve Küçükçolak, A. (2018) "Kira Sertifikaları, Türkiye Tecrübesi ve Bir Vaka Çalışması", *Istanbul Journal Of Economics* 68:1-44.

Klein, P.O., Weill, L. ve Godlewski, C.J. (2015) "How Sukuk Shapes Firm Performance", *Laboratoire De Recherche En Gestion Et Economie (Large), Université De Strasbourg, Strasbourg*.

Mazgit, İ.,(2013) "Endeks Kapsamında Olmanın Hisse Senedi Getirilerine Etkisi: Bıst Temettü 25 Endeksi Üzerine Bir Uygulama", *Sosyo Ekonomi*, 20(20):226-264.

Ramasamy, R., Munisamy, S. ve Mohd Helmi, M.H. (2011) "Relative Risk Of Islamic Sukuk Over Government And Conventional Bonds", *Global Journal Of Management And Business Research*, 11(6): 5-12.

Rusgianto, S. ve Ahmad, N. (2013) "Volatility Behavior Of Sukuk Market: An Emprical Analysis Of The Dow Jones Citigroup Sukuk Index", *Middle East Journal Of Scientific Research*, 13(1):93-97.

Spk (2010) 01.04.2010 Tarihli, Kira Sertifikalarına Ve Varlık Kiralama Şirketlerine İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ, <http://www.resmigazete.gov.tr/eskiler/2010/04/20100401-15.Htm>,(15.12.2018).

Tok, A. (2009) "İslami Finans Sistemi Çerçevesinde Sukuk (İslami Tahvil) Uygulamaları, Katılım Bankaları Ve Türkiye Açısından Değerlendirmeler",*Yeterlik Etüdü, Sermaye Piyasası Kurulu Hukuk İşleri Dairesi, Ankara*.

Vishwanath, S.R. ve Azmi, S. (2009) "An Overview Of Islamic Sukuk Bonds", *The Journal Of Strutred Finance*, 14(4):58-67.

Wilson, R. (2008)"Innovation İn The Structuring Of Islamic Sukuk Securities", *Humanomics*, 24 (3):170-181.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Yakar, S., Kandır, S.Y. ve Önal, Y.B. (2013) “Yeni Bir Finansman Aracı Olarak “Sukuk-Kira Sertifikası” ve Vergisel Boyutunun İncelenmesi”,Bankacılar Dergisi, 84:72-94.

Yazgan, K.F. (2017) “Kurumsal Yönetim Derecelendirmesinin Hisse Senedi Performansına Etkisi: Bist Kurumsal Yönetim Endeksi Üzerine Bir İnceleme”, Balıkesir Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, Yüksek Lisans Tezi, Balıkesir.

Yılmaz, E. (2014) “Yeni Bir Finansal Araç Olarak Sukuk: Çeşitleri, Türkiye Uygulaması ve Vergilendirilmesi”, Muhasebe ve Finansman Dergisi, Ocak:81-100.



**A TIME-SERIES ANALYSIS OF REAL WAGES-EMPLOYMENT RELATIONSHIP IN
TURKISH MANUFACTURING INDUSTRY**

Prof. Dr. Hacer Simay KARAALP-ORHAN*

ABSTRACT

Efficiency wage theorem, which examines the relationship between wage and productivity, was introduced by the New Keynesian economists in the 1960s, unlike the classical marginal productivity and neoclassical wage theory, has provided a description of downward wage rigidity and involuntary unemployment. According to the marginal productivity theory, the productivity of workers affects wages, whereas according to the efficiency wage theorem the wage level affects the productivity of workers. Accordingly, a higher wage premium or an efficiency wage above the market clearing wage level will increase the productivity and reduce costs. If workers receive higher wages they will feed better and thus healthier, the shirk (loaf) of workers will decrease and their motivation will increase, as a result more qualified workers will be hired and the labour turn over will decrease. In this context, this study aims to investigate the relationship between labour productivity and real wages, by employing the Johansen cointegration test and applies Granger causality test for the period 2009:01–2018:02.

Keywords: Labour productivity, Real wages, Turkey

JEL Codes: E24, J21, C22

**İMALAT SANAYİNDE REEL ÜCRET İSTİHDAM İLİŞKİSİNİN ZAMAN SERİSİ ANALİZİ:
TÜRKİYE ÖRNEĞİ**

ÖZ

Ücret ve verimlilik arasındaki ilişkiyi inceleyen Etkin ücret teoremi, 1960'larda Yeni Keynesyen iktisatçılar tarafından ortaya atılmış ve Klasik marjinal verimlilik ve neoklasik ücret teorisinden farklı olarak aşağı doğru ücret katılığı ve gayri iradi işsizliğin bir açıklamasını sağlamışlardır. Marjinal verimlilik teorisine göre ücretin düzeyini işçinin üretimi yani verimliliği belirlemekte iken etkin ücret

* Pamukkale University, Faculty of Economics and Administrative Sciences, Kınıklı Campus, Kınıklı /Denizli, Turkey, skaraalp@pau.edu.tr

teoreminde işçinin ücretini verimliliği belirlemektedir. Buna göre firmaların piyasa ücret düzeyinden daha yüksek bir ücret yada başka bir deyişle etkin ücret ödemeleri işçilerin verimliliğini arttıracak ve maliyetleri düşürecektir. Teoriye göre, yüksek ücret ödenen işçilerin beslenmeleri ve fiziksel sağlıkları artacak, işçilerin kayıtları engellenecek ve motivasyonları artacak, böylelikle daha nitelikli işçiler istihdam edilecek ve işçi devir hızı düşük olacaktır. Bu bağlamda, bu çalışmada 2009:01-2018:02 dönemi için Türkiye imalat sanayinde reel ücretler ve ortalama işgücü verimliliği arasındaki ilişkiyi Johansen eşbütünleme ve Granger nedensellik testleri kullanılarak araştırılmıştır.

Anahtar Kelimeler: Reel ücretler, Verimlilik, Türkiye

JEL Kodları: E24, J21, C22

1. INTRODUCTION

The relationship between productivity and real wages has been considered as one of the important issues in the economics literature. In macroeconomic perspective, with the effect of globalization and openness of countries to international trade, the growth of productivity and wages become crucial factors, which decide the international competitiveness between countries. The increase in productivity and competitiveness induces economic growth. This is especially true for the countries that are able to increase their welfare by the job creation concomitant with economic growth. Productivity refers to how effectively resources are used. Productivity is measured by aggregation of all production factors (total factor productivity) or labour productivity (the ratio of labour used in the production of output or value added to total output / value added).

This study aims to investigate the relationship between average labour productivity and real wages in the Turkish manufacturing industry by using cointegration analysis and Granger causality test. The quarterly dataset covers the period of 2009:01–2018:02. In this context, this paper is structured as follows. Section 2 explains the theoretical background. Section 3 presents the selected literature review. Section 4 describes the data, methodology and the empirical results and Section 5 concludes.

2. THEORETICAL BACKGROUND

Marginal productivity theory state that employers determine the wages according to the contribution or productivity of the workers. The theory implies that, under conditions of perfect competition, every worker of the same skill and efficiency will receive a wage equal to the value of the marginal product of that type of labour. The contrary relationship was discussed in detail by Akerlof, Shapiro and Stiglitz, Solow and Yellen within the framework of the Efficiency Wage Theory. Efficiency wage theory stated that increasing wages can lead to increased labour productivity. Where monitoring

is costly or difficult, incentives to work are thought to be provided by higher than market clearing wages, unemployment, or both. Higher wages attract better or more productive workers from a higher labour pool under the adverse selection hypothesis, assuming a correlation between productivity and reservation wage; these workers carry an internal incentive to perform well (Spitz, 1989). There are also different variants of efficiency wage models for developed and also developing countries. These are the shirking model, the nutrition-based efficiency wage, the labour turnover model, adverse selection models, gift exchange models.

3.LITERATURE REVIEW

There are many studies that analyze the relationship between labour productivity and real wages. However, a significant number of studies include the unemployment, employment or inflation as an explanatory variable to the analysis. The results of selected studies are far from consistent. For example, Janet Spitz (1989) and Jonathan Leonard (1987) found no relation between high relative wages and productivity. Levine (1991) examined the efficiency wage theories in the United States and Japan by employing the data are from 1982-83 surveys of manufacturing establishments in the Indianapolis area in the U.S. and from the Kanagawa prefecture in Japan. The results largely support efficiency wage theories in both countries. Alexander (1993) investigated the relationship between productivity, wages, and unemployment in the United Kingdom for the period 1955–91 by employing the cointegrating VAR methodology and the Granger causality. He found a strong bivariate causality between wages and productivity' after 1979. Wakeford (2004) analyzed the relationship between productivity, real wages, and unemployment in South Africa by using cointegration and the Granger causality tests for the period of 1983: Q1 to 2002: Q4 and found a long-term equilibrium between the variables. The results indicate that productivity has grown faster than real wages. Pazarlıoğlu and Çevik (2007) analyzed the relationship between productivity, real wages, and unemployment in Turkey by employing cointegration and causality tests for the period of 1945–2005. He found the evidence of a structural break in 1967 and bi-directional causality between the productivity and real wages were found for the period of 1969–2005, and then productivity became a central variable for the period of 1969–2005. Yusof (2008) examined the long-run and dynamic behaviours of real wage-employment-productivity relationship for the Malaysian manufacturing industry over the period of 1992: Q1– 2005: Q3. His findings indicated a long-run relationship between the variables. The theory that real wages inversely affect employment was not supported, while the performance-based pay scheme theory (but not the efficiency wage theory), was validated. Yıldırım (2015) examined the interrelationships among productivity, real wages and inflation in the Turkish manufacturing industry for the period of 1988:1 to 2012:2 by employing both cointegration analysis and a Granger causality test. He found no causal link running from productivity

to real wages in the Turkish manufacturing industry. Karaalp-Orhan (2017) investigated the relationship between labour productivity, average real wages, and the unemployment rate by employing the bounds testing procedure within an autoregressive distributed lag (ARDL) modelling approach and applies Toda-Yamamoto causality test for the period 2007:01–2016:04. The results indicated that real wages and unemployment have a significant and positive long-run impact on labour productivity. However, Toda-Yamamoto's causality test results indicated the absence of the relationship between real wages and labour productivity.

4. METHODOLOGY AND EMPIRICAL RESULTS

In order to explore the relationship between labour productivity and real wages in the Turkish manufacturing sector the following equation can be written:

$$\ln PROD_t = \gamma_0 + \gamma_1 \ln RW_t + \varepsilon_t \quad (1)$$

where, $PROD_t$, is the labour productivity, RW_t is the real wages and ε_t is the regression error term.

This study uses quarterly data for labour productivity and the real wages for 2009:1–2018:2 period. The productivity represents average labour productivity (production index/employment index) in the Turkish manufacturing industry. Industrial Production index, employment index and gross wages-salaries index (2015=100) are employed to find labour productivity and nominal wages. The real wages are obtained by deflating the nominal wage index with the consumer price index (CPI) (2003= 100). All values of CPI converted to the base year 2015. All seasonally and calendar adjusted data are obtained from the Turkish Statistical Institute (TurkStat). The variables are transformed into a natural logarithmic form.

4.1. Unit Root Tests

The implementation of the Granger Causality Test (Granger, 1969) requires all variables to be stationary. Engle and Granger (1987) stated that it is necessary to take the differential of a non-stationary series to make stationary. In order to avoid the potential problem of spurious relationships and incorrect inferences, all variables are stationarized. In order to test the stationarity of variables and the integration and the possible cointegration among the variables, the augmented Dickey–Fuller (ADF) test (Dickey and Fuller, 1981) and an alternative Phillips–Perron (PP) unit-root test (Phillips and Perron, 1988) are employed. Table 2 gives the ADF and PP unit root testing results of labour productivity and real wages, and unemployment.

Table 1. ADF and PP Tests for Unit Root

| ADF | | | | |
|-------|--------------|---------------|------------------|---------------|
| | Level | | First Difference | |
| | τ_{μ} | τ_{η} | τ_{μ} | τ_{η} |
| LPROD | -1.825[0] | -2.367[0] | -5.406[0]*** | -5.307[0]*** |
| RW | 0.228[0] | -3.954[0]** | -5.341[0]*** | -7.591[0]*** |
| PP | | | | |
| | Level | | First Difference | |
| | τ_{μ} | τ_{η} | τ_{μ} | τ_{η} |
| LPROD | -1.823[3] | -2.670[4] | -5.406[3]*** | -5.306[3]*** |
| RW | 0.531[4] | -3.939[1]** | -8.922[7]*** | -8.757[7]*** |

Note: All series are at their natural logarithms except the unemployment rate. τ_{μ} represents the model with a drift and without trend; τ_{η} is the most general model with a drift and trend. The optimal lag lengths used in the ADF test are indicated within brackets and determined by the AIC. When using PP test, the values in brackets represent Newey-West Bandwidth (as determined by Bartlett Kernel). (*), (**), and (***) indicate that the corresponding coefficient is significant at 10%, 5%, and 1% levels, respectively.

All series' ADF test results failed to reject the null hypothesis of the existence of a unit root for the data at log levels and were found stationary at their first difference I(1). Secondly, in order to investigate the Granger causality relationship between variables, cointegration tests are required to be investigated.

4.2. Johansen Cointegration Tests

The existence of a long-run relationship between variables was tested using the "Johansen Cointegration Tests" (Johansen, 1988; Johansen and Juselius, 1990). The optimal lag lengths of the analysis are found according to Akaike Information Criteria (AIC), which suggested different lag lengths for each analysis. The results of the Johansen Cointegration Tests are shown in Table 2.

Table 2. Johansen Cointegration Tests and Estimates

| Variables | AIC | Trace Statistics | Max Statistics | 5% | | Results | |
|-----------|-----|------------------|----------------|---------|-------|-------------|--------------|
| | | | | (trace) | (max) | | |
| PROD | 8 | 19.676** | 18.828** | 15.41 | 14.07 | $r=0, r>1$ | Cointegrated |
| RW | | 0.847 | 0.847 | 3.76 | 3.76 | $r=1, r>=2$ | |

Note: (**) indicates that test statistics is significant at 5% level, AIC

The results of Table 2 indicate the rejection of the null hypothesis of no cointegration. In this context, the existence of a cointegration relationship was found between labour productivity and wages,

which indicates a long-run equilibrium relationship between these series for Turkey in the aforementioned period.

4.3. Weak Exogeneity Tests

Weak exogeneity test is employed whether the variables are exogenous or endogenous. The null hypothesis is weak exogeneity. If the null hypothesis is accepted the variable is found exogenous. This means that the aforementioned variable does not respond to any deviation from the long run equilibrium (Arslan and Yapraklı, 2008). Therefore, the exogenous variable cannot be regarded as the dependent variable; hence the error correction model cannot be applied and becomes redundant. However, rejection of the null of weak exogeneity indicates the long run relationship among the variables.

Table 3. Tests for Weak Exogeneity

| Variables | Constraint vectors | LR Test () | p-value |
|-------------|--------------------|----------------|---------|
| PROD | $H_1' (1 \ 0)$ | 3.53** | 0.060 |
| RW | $H_1' (1 \ 0)$ | 15.2*** | 0.000 |

Note: (**) and (***) indicate that the corresponding coefficient is significant at 5% and 1% levels, respectively.

Table 3 reports the results of the weak exogeneity tests. The H0 null hypothesis, weak exogeneity is rejected only the variables. Both variables are found to be endogenous variables. Table 4 also indicates that all cointegration results, which are set by normalization constraint to productivity equation, in other words, determined by labour productivity as dependent variables for the manufacturing sector are valid.

Table 4. Long-run Relationship

| Equations | t-statistics |
|------------------|--------------|
| $PROD = 0.15 RW$ | (-3.49)*** |
| $RW = 0.03 PROD$ | (-0.69) |

Note: (***) indicates the corresponding coefficient is significant at 1% level

For the period 2009:1-2018:2, 1% increase in real wages increases the productivity of the manufacturing industry by 0.15%.

4.4. Error Correction Models and Granger Causality

Granger causality test results are sensitive to changes in the dependent variable lag. The lag lengths of the causality analysis are determined according to the AIC and the criterion suggesting different lag lengths for each analysis. VECMs for Granger causality tests are given below.

$$\Delta PROD_t = \phi_0 + \phi_1 \Delta PROD_{t-1} + \phi_2 \Delta PROD_{t-2} + \phi_3 \Delta PROD_{t-3} + \phi_4 \Delta PROD_{t-4} + \phi_5 \Delta PROD_{t-5} + \phi_6 \Delta PROD_{t-6} + \phi_7 \Delta PROD_{t-7} + \phi_8 \Delta PROD_{t-8} + \phi_9 \Delta RW_t + \phi_{10} \Delta RW_{t-1} + \phi_{11} \Delta RW_{t-2} + \phi_{12} \Delta RW_{t-3} + \phi_{13} \Delta RW_{t-4} + \phi_{14} \Delta RW_{t-5} + \phi_{15} \Delta RW_{t-6} + \phi_{16} \Delta RW_{t-7} + \phi_{17} \Delta RW_{t-8} + \phi_{18} ECT_{t-1} + \varepsilon_{1t} \tag{2}$$

$$\Delta RW_t = \alpha_0 + \alpha_1 \Delta RW_{t-1} + \alpha_2 \Delta RW_{t-2} + \alpha_3 \Delta RW_{t-3} + \alpha_4 \Delta RW_{t-4} + \alpha_5 \Delta RW_{t-5} + \alpha_6 \Delta RW_{t-6} + \alpha_7 \Delta RW_{t-7} + \alpha_8 \Delta RW_{t-8} + \alpha_9 \Delta PROD_t + \alpha_{10} \Delta PROD_{t-1} + \alpha_{11} \Delta PROD_{t-2} + \alpha_{12} \Delta PROD_{t-3} + \alpha_{13} \Delta PROD_{t-4} + \alpha_{14} \Delta PROD_{t-5} + \alpha_{15} \Delta PROD_{t-6} + \alpha_{16} \Delta PROD_{t-7} + \alpha_{17} \Delta PROD_{t-8} + \alpha_{18} ECT_{t-1} + \varepsilon_{2t} \tag{3}$$

The results of the short-run and long-run Granger causality test based on the VECM are given in Table 5.

Table 5. Granger Causality Test

| Variables | ECT _{t-1} (t-statistics) | F statistics (prob) | RESULTS | |
|-------------------------|--------------------------------------|------------------------|-------------------------|-----------|
| | | | Long Run | Short Run |
| <i>PROD</i> - <i>RW</i> | -0.511(-4.80)*** | 25.16(0.001) | <i>RW</i> → <i>PROD</i> | |
| <i>RW</i> - <i>PROD</i> | -1.953(-2.09)*** | 4.06 (0.851) | <i>PROD</i> → <i>RW</i> | - |

Note: (***) indicates the corresponding coefficient is significant at 1% level.

Test results indicate that there are at least one short-run and long-run relationship between variables. Real wages affected labour productivity both in the long-run and the short-run. While a unidirectional causality relationship is found from real wages to labour productivity in the manufacturing sector in the long-run, a bilateral relationship is found between labour productivity and the real wages in the long-run.

5. CONCLUSION

This study has empirically investigated the relationship between labour productivity, average real wages in Turkish manufacturing industry using quarterly data from 2009:1 to 2018:2. The cointegration results show a long-run equilibrium relationship between real wages and productivity. In other words, the effect of the real wages on productivity can be observed in the long-run. The causality tests indicate the unilateral relationship between real wages and productivity. Both in the short-run and the long-run time period, real wages affected productivity. This result also indicates low wage structure of Turkish manufacturing industry. The increase in the real wages will increase the productivity of workers confirms the efficiency wage theorem in Turkey. However, the productivity affected the real wages only in the long-run. As mentioned in the previous studies, due to the low productivity levels of the Turkish economy, marginal productivity theory can be effective only in the long-run time period.

REFERENCES

- Alexander, C.O. (1993) "The Changing Relationship between Productivity, Wages and Unemployment in the UK", *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 55(1):87–102.
- Arslan, İ. and Yapraklı, S. (2008), "Banka Kredileri ve Enflasyon Arasındaki İlişki: Türkiye Üzerine Ekonometrik Bir Analiz (1983-2007)." *İstanbul Üniversitesi İktisat Fakültesi Ekonometri ve İstatistik Dergisi*, 7: 88-103.
- Levine D. I. (1991) "You Get What You Pay For: Tests of Efficiency Wage Theories In The United States and Japan." IRLE Working Paper No. 26-91. <http://irle.berkeley.edu/workingpapers/26-91.pdf>, (18.12.2018).
- Dickey, D.A. and W.A. Fuller (1979) "Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with A Unit Root." *Journal of the American Statistical Association*, 74(366): 427–431.
- Granger, C.W.J. (1969) "Investigating Causal Relations by Econometric Models and Cross-Spectral Methods", *Econometrica*, 37(3): 424–438.
- Engle, R., Granger, C.W.J. (1987) "Cointegration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing." *Econometrica*, 55(2): 251–76.
- Johansen, S. (1988) "Statical Analysis of Cointegration Vectors", *Journal of Economic Dynamic and Control*, 12(2-3): 231-254.
- Johansen, S. and Juselius, K. (1990) "Maximum Likelihood Estimation and Inferences on Cointegration with Applications to the Demand for Money", *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 52(2): 169-210.
- Karaalp-Orhan H.S. (2017) "Labour Productivity, Real Wages and Unemployment: An Application of Bounds Test Approach for Turkey", *Journal of Economic and Social Development*, 4(2):11-22.
- Leonard, J. (1987) "Carrots and Sticks: Pay, Supervision and Turnover", *Journal of Labor Economics*, 5(4): 136-153.
- Pazarlıoğlu, V. and Çevik, E.İ. (2007) "Verimlilik, Ücretler ve İssizlik Oranları Arasındaki İlişkinin Analizi: Türkiye Örneği", *Yönetim ve Ekonomi*, 14(2):1–17.
- Phillips, P.C.B. and Perron, P. (1988), "Testing For A Unit Root in Time Series Regression", *Biometrika*, 75(2): 335–346.
- Spitz, J., (1989), "An Empirical Test of Efficiency Wage Theory", Graduate School of Business, Research paper 1053, Stanford University.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

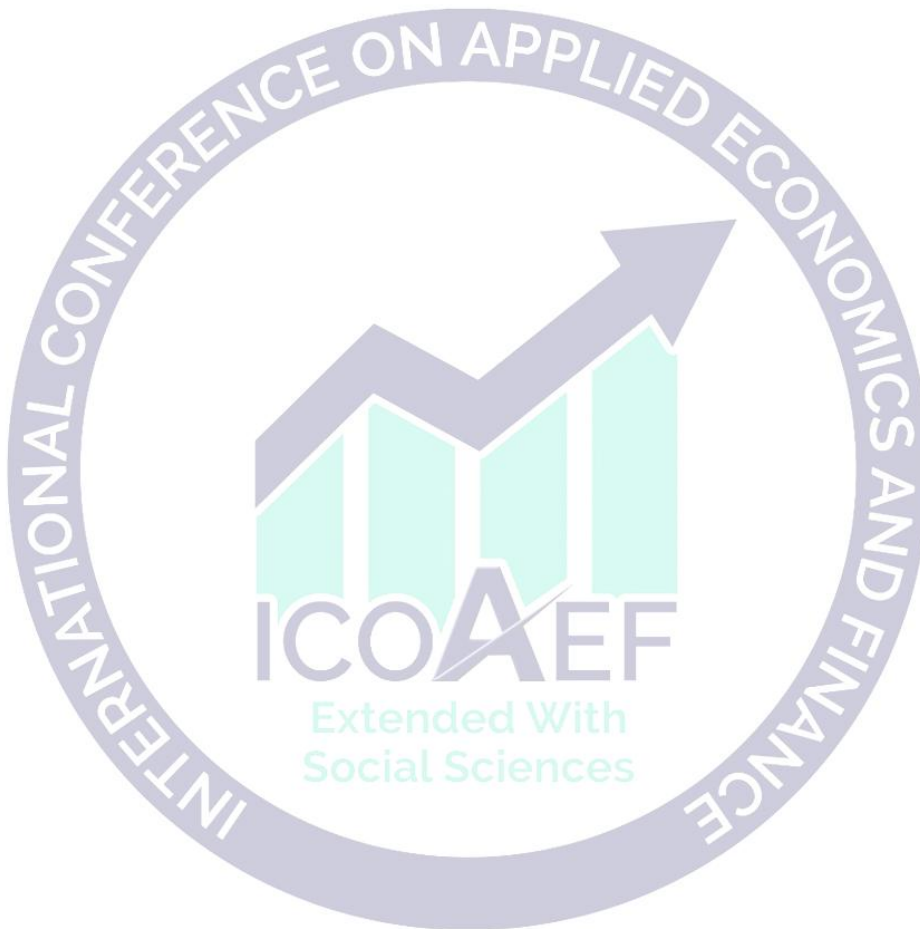
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Wakeford, J. (2004) "The Productivity-Wage Relationship In South Africa: An Empirical Investigation. *Development Southern Africa*", 21(1):109–132.

Yıldırım, Z. (2015) "Relationships among labour Productivity, Real Wages and Inflation in Turkey", *Economic Research-Ekonomska Istraživanja*, 28(1): 85-103,

Yusof, S.A. (2008) "The Long-Run and Dynamic Behaviors of Wages, Productivity and Employment in Malaysia", *Journal of Economic Studies*, 35(3): 249 – 262



**THE EMPLOYMENT INTENSITY OF GROWTH: A SECTORAL ANALYSES FOR
TURKEY**

Prof. Dr. Hacer Simay KARAALP-ORHAN*

ABSTRACT

Employment of workforce, reduction of unemployment and its effect on economic growth are one of the subjects that overemphasized by both developing and developed countries. A bilateral relationship is found between economic growth and employment while sustaining economic growth increases employment, employment growth increases production and economic growth. In this context, this paper examines employment elasticities for the three broad economic sectors including agriculture, industry and for different demographic groups such as women and youth over the period of 2005-2015. The results indicate the inconsistency and volatility between economic growth and employment, and unsustainable economic growth in Turkey. These results also confirm the structural change of the agricultural sector. In the scope of inclusive growth, it has been found that there has been a decrease in labour productivity from time to time. While the employment intensity of growth for women was found higher than men, the youth cohort has experienced low and stagnant employment elasticities.

Keywords: *Economic Growth, Employment, Employment Elasticity*

JEL Codes: *E24, J21, O40*

ÖZET

İşgücünün istihdam edilmesi, işsizliğin azaltılması ve bunun ekonomik büyüme üzerindeki etkileri gerek gelişmiş, gerekse gelişmekte olan ülkelerin üzerinde önemle durduğu konuların başında gelmektedir. Çift yönlü bir ilişkinin bulunduğu ekonomik büyüme ve istihdam arasında, sürdürülebilir bir ekonomik büyüme istihdamı arttırırken, istihdam artışı üretimi ve ekonomik büyümeyi arttırmaktadır. Bu çalışmada 2005-2015 döneminde Türkiye’de ekonomik büyümenin istihdam yaratma kapasitesi incelenmiştir. Bu kapsamda çalışmada tarım, sanayi, hizmetler olmak üzere ana sektörler ve kadın ve gençler gibi farklı demografik gruplar için istihdam esnekliği hesaplanmıştır. Elde edilen sonuçlara göre 2005-2015 döneminde Türkiye’de sürdürülebilir bir büyümenin gerçekleşmediği,

* Pamukkale University, Faculty of Economics and Administrative Sciences, Kınıklı Campus, Kınıklı /Denizli, Turkey, skaraalp@pau.edu.tr

büyüme-istihdam ilişkisinde tutarsızlık ve oynaklık olduğu tespit edilmiştir. Tarım sektöründe elde edilen negatif sonular ekonomideki yapısal değişimi doğrular niteliktedir. Özellikle kriz sonrası dönemde inşaat sektöründeki ekonomik büyümenin oldukça fazla istihdam yarattığı dikkati çekmektedir. Bu durumun kapsayıcı büyüme çerçevesinde önemli bir gelişme olmasına karşın, zaman zaman emek verimliliğinde düşüşlerin yaşandığı bulunmuştur. Ekonomik büyümenin kadınlarda daha fazla istihdam yarattığı tespit edilirken, gençlerin ekonomik büyümeden aldıkları pay oldukça yetersiz bulunmuştur.

Anahtar Kelimeler: *Ekonomik Büyüme, İstihdam, İstihdam Esnekliği*

JEL Kodları: *E24, J21, O40*

1. INTRODUCTION

In addition to the employment-related economic indicators such as unemployment rate, employment rate and labour force participation rate, “employment creation capacity of economic growth - employment elasticity” is another labour market indicators to measure the ability of economies to generate sufficient employment opportunities and then to provide valuable information about the macroeconomic performance of the countries. Kapsos (2005) stated that the concepts of “employment intensity of growth” or “employment elasticity” or “job intensity of growth” or “elasticity of employment with respect to output” can be used as the same statement interchangeably. The employment intensity of growth can be used to measure how economic growth of output can provide employment opportunities for their populations.

While the debates about jobless growth and employment elasticity were present in many developed and developing countries, it has been even more pronounced in Turkey over the past decades. Turkey is a large populated developing country with distinctive characteristics of the labour market. In this context, this study aims to analyse the employment creation capacity of Turkish economic growth. This study also examines employment elasticities for agriculture, industry and services sectors and different demographic groups such as women and youth. The rest of the paper is organised as follows. Section 2 presents the relationship between employment and economic growth, section 3 outlines the empirical methodology and the data. Section 4 contains a discussion of the main results and the last section concludes the paper.

2. THE RELATIONSHIP BETWEEN EMPLOYMENT AND ECONOMIC GROWTH

A bidirectional relationship is found between economic growth and employment while employment growth increases production and economic growth, sustainable economic growth increases employment.

If the economic growth of a country based on low productivity increases, per capita income increases are slowing and developing countries can catch the middle-income trap. The middle-income trap is an economic development situation in which a country's growth slows after reaching middle-income levels and country's income will get stuck at that level. On the other hand, employment growth is relatively low in a largely labour-saving economic growth based on the increase in technology and total factor productivity. Although this type of growth has a positive effect, in the long run, it will not lead to decrease unemployment adequately and in the short-run. For this reason, this growth refers to an asymmetrical relationship called «jobless growth» in the short-run. In order to reduce the unemployment rate, «employment friendly growth» is preferred especially in the high population growth rate and thus high labour supply growth countries such as Turkey. However, in order to achieve economic development objectives such as poverty reduction, employment growth and productivity growth must be jointly pursued (ILO, 2005a).

3.DATA AND THE METHODOLOGY

3.1.Data and the Limitation of the Study

The data used in the analysis are from the TurkStat (Turkish Statistical Institute). Gross Domestic Product in Constant Prices by Kind of Economic Activity, NACE Rev. 2 - (in constant \$1998) was utilized for economic growth and the labour force statistics by economic activity were used for the employment data. This study comprises the period from 2005 to 2015. The study is limited to this time period is due to the limitations of the data. First of all, in this study, Labour Force Statistics which are compiled according to TURKSTAT Household Labour Force Survey results are used. Due to the revision of household labour force survey based on 2008 Population Projection, comparing and using the revised periods of 2008-based projections together with other periods of time series analysis will be entirely misleading (TurkStat, 2018c). For this reason, it is not possible to compare the yearly data before and after 2004. Therefore, the previous data of 2004 were not included in the study. In addition to this, the economic growth data, GDP in constant prices according to the 1998 based year is ended in 2015. Thus the study covers the period of 2005-2015.

3.2.Methodology

The employment intensity is the ratio of percentage change in the number of employed persons in an economy (region, or province) associated with a percentage change in economic output (GDP). Employment elasticity captures the responsiveness of employment to changes in output (Basu and Das, 2015:5). It measures how much employment growth is associated with a 1 percentage point of economic growth (Kapsos, 2005:1). The methodology that is used in this study is the arc elasticity of employment:

$$\varepsilon_{it} = \frac{(E_{i1} - E_{i0}) / E_{i0}}{(Y_{i1} - Y_{i0}) / Y_{i0}} \quad (1)$$

where i is the country, E is the employment, Y is the output (GDP) and 0 and 1 shows the periods.

According to the changes in GDP growth rate and results of ε , the interpretation of the formula can be classified as 6 categories. If the country has positive GDP growth and $\varepsilon < 0$ indicate negative employment growth and positive productivity growth. In economies with positive GDP growth and elasticity between zero and one, $0 \leq \varepsilon \leq 1$ is the ideal situation where both positive employment and productivity growth. This shows the job growth and productivity gains together. However, higher elasticities within this range corresponds to more employment-intensive (lower productivity) growth. $\varepsilon > 1$ with positive GDP growth correspond with positive employment growth and negative productivity growth. This can be considered the over employment for the countries. On the other hand, inverse interpretation is valid if the county has negative GDP growth with the aforementioned elasticity results. Although the trends in employment intensity are indicative of the response of employment in terms of quantity of employed persons to GDP growth, the indicator does not give any information about the changes in the quality of jobs or growth in the number of “decent” jobs (Kapsos, 2005:2). It is important to state that the relationships between productivity, employment and output may not hold in cases in which employment corresponds to a population subgroup (such as youth or women) and where total output is used instead of output for the population subgroup (Kapsos, 2005:4).

4. THE RESULTS OF THE EMPLOYMENT ELASTICITIES

After the 2001 economic crisis, the Turkish economy has achieved a dynamic and stable growth. The economic structure has undergone a serious crust change, but the labour markets have not experienced a transformation parallel to this change (Karagöl and Akgeyik, 2010). Until the period of the 2008 economic crisis, Turkey's economy grew at a fairly high rate and the economic growth rate in 2004 and 2005 was recorded as 9.3% and 8.4%, respectively. However, due to the expected increase in the unemployment rate did not occurred and the unemployment rate was around 10%, the “jobless growth” phenomenon has been raised before the crisis.

Table 1. Employment Elasticity of Growth (2005-2105)

| Years | GDP growth rate (%) | Total ϵ | Non-agricultural GDP growth rate (%) | Non-agricultural sectors ϵ |
|--------------|----------------------------|------------------------------------|---|---|
| 2005 | 8.4 | 0.00 | 8.7 | 0.58 |
| 2006 | 6.9 | 0.22 | 8.2 | 0.55 |
| 2007 | 4.7 | 0.30 | 6.1 | 0.41 |
| 2008 | 0.7 | 2.86 | 0.9 | 2.16 |
| 2009 | -4.8 | -0.02 | -4.3 | 0.17 |
| 2010 | 9.2 | 0.65 | 9.8 | 0.58 |
| 2011 | 8.8 | 0.73 | 9.2 | 0.70 |
| 2012 | 2.1 | 1.38 | 2.2 | 1.99 |
| 2013 | 4.2 | 0.67 | 5.0 | 0.82 |
| 2014 | 2.9 | 1.86 | 3.9 | 1.38 |
| 2015 | 4.0 | 0.68 | 4.3 | 0.76 |
| 2005-2015 | 4.3 | 0.85 | 4.9 | 0.92 |

At a first glance, an inconsistency and volatility are observed in the growth-employment relationship of Turkey over the period of 2005-2015. While the average growth rate of Turkey was 4.3% over the period of 2005-2015, an inconsistent economic growth was found with fluctuations. This implies that economic growth of Turkey is not sustainable.

The results are shown in Table 1 shed light on trends in employment and productivity between 2005 and 2015. Following the economic growth rates, the employment elasticities of Turkey display large fluctuations from one period to the next. While the average economic growth is 4.3, the employment intensity growth is found 0.85 during the period. Although the elasticity result is found between 0 and 1, ($\epsilon=0.85$), the higher elasticities within this range ($0<\epsilon<1$) correspond to more employment-intensive (lower productivity) growth. For every 1% point of additional GDP growth, total employment has grown between 0.85% point between 2005 and 2015. Instead of productivity gains, the economic growth of Turkey attributed to rising the labour supply. The non-agricultural sector has experienced high employment elasticity. A higher employment elasticity in this sector also implies low productivity and high employment increase in Turkey. Due to the ongoing structural transformation in the economy, the continuation of the shift from agriculture to non-agricultural sectors was effective in Turkey. Kahn (2001) asserts that employment elasticities in developing economies should ideally be around 0.7 until these economies attain upper-middle-income status. He demonstrates that employment elasticities gradually fall as a country becomes more developed and more labour scarce. Kahn (2001) argues that labour abundant economies, and especially those with relatively high incidences of poverty, need to achieve relatively higher employment intensity than do less labour-abundant economies.

However, in order to achieve the level of economic growth that creates employment, it is a prerequisite to increasing productive investments. Long-term sustainable economic growth is intended to be inclusive of all sectors (inclusive growth), to be focused on labour productivity, to increase productive employment and to contribute to the reduction of poverty. In the low productivity increase, per capita income increases are slowing and developing countries such as Turkey can catch the middle-income trap. In order to achieve the employment creation economic growth level and escape from middle-income trap, increasing productive investments is a prerequisite for the countries such as Turkey. Table 2 provides total employment elasticities by broad economic sectors.

Table 2. Sectoral Employment Elasticities (2005-2105)

| Years | Sector GDP | Agriculture | Sector | Industry | Sector | Construction | Sector GDP | Services |
|-----------|-----------------|-------------|---------------------|----------|---------------------|--------------|-----------------|----------|
| | growth rate (%) | ε | GDP growth rate (%) | ε | GDP growth rate (%) | ε | growth rate (%) | ε |
| 2005 | 7.2 | -1.94 | 8.7 | 0.84 | 9.3 | 1.27 | 8.5 | 0.32 |
| 2006 | 1.4 | -5.71 | 8.4 | 0.33 | 18.4 | 0.43 | 7 | 0.65 |
| 2007 | -6.7 | 0.35 | 5.8 | 0.16 | 5.6 | 0.55 | 6.3 | 0.47 |
| 2008 | 4.3 | 0.38 | 0.4 | 8.45 | -8.1 | -0.07 | 2.3 | 0.76 |
| 2009 | 3.6 | 0.78 | -6.9 | 1.24 | -16.1 | -0.31 | -1.8 | -0.91 |
| 2010 | 2.4 | 2.76 | 13 | 0.73 | 18.3 | 0.49 | 7.6 | 0.42 |
| 2011 | 6.1 | 1 | 9.7 | 0.48 | 11.5 | 1.27 | 8.7 | 0.61 |
| 2012 | 3.1 | -0.67 | 1.8 | 0.68 | 0.5 | 3.86 | 2.5 | 2.24 |
| 2013 | 3.5 | -0.54 | 3.4 | 1.15 | 7.3 | 0.39 | 5.5 | 0.74 |
| 2014 | -2.1 | -2.37 | 3.8 | 1.06 | 2.1 | 3.48 | 4.2 | 1.25 |
| 2015 | 7 | 0.03 | 3.7 | 0.08 | 1.6 | 0.06 | 4.9 | 0.96 |
| 2005-2015 | 2.7 | -0.53 | 4.7 | 1.38 | 4.6 | 1.04 | 5.1 | 0.68 |

While the agricultural sector makes very low contributions to GDP increases, it still has a high level of employment, and importantly, it leads to high employment increases and decreases. Over the period of 2005-2015, while the economic growth rate of the agricultural sector was 2.7%, employment elasticity was found -0.53. This result indicates negative employment growth in agricultural sector. The agricultural sector has been driven more by gains in productivity than by gains in employment. This result fits the structural transformation of the Turkish economy and shrinking the employment of share of the sector. However, the industry and construction sectors have experienced employment growth over the full period, the elasticity of industry and construction employment to GDP was larger than services. The findings indicate that during the economic development of the labour supply in the agricultural sector flows to the manufacture, constructor and service sectors, respectively. A close relationship was found between increasing employment intensity in the manufacturing industry and poverty reduction. However, positive economic growth and positive industrial employment elasticities $\epsilon=1.38$ indicate the reduction of productivity in the industry sector.

Table 3 provides total employment elasticities by age and gender along with the annual GDP growth rates.

Table 3. Employment Elasticities By Gender And Age Group

| Years | GDP growth rate (%) | Female | Male | Youth (15-24 age) | | |
|-----------|---------------------|--------|------|-------------------|--------|-------|
| | | | | Total | Female | Male |
| 2005 | 8.4 | 0.14 | 0.3 | 0 | 0.16 | -0.32 |
| 2006 | 6.9 | 0.42 | 0.2 | -0.08 | -0.02 | -0.2 |
| 2007 | 4.7 | 0.39 | 0.3 | -0.24 | -0.29 | -0.17 |
| 2008 | 0.7 | 6.38 | 2.01 | -0.36 | -1.46 | 1.87 |
| 2009 | -4.8 | -1.02 | 0.25 | 0.93 | 1.18 | 0.47 |
| 2010 | 9.2 | 1.02 | 0.53 | 0.44 | 0.39 | 0.56 |
| 2011 | 8.8 | 0.96 | 0.68 | 0.76 | 0.89 | 0.52 |
| 2012 | 2.1 | 2.29 | 1.04 | -0.64 | -0.21 | -1.48 |
| 2013 | 4.2 | 1.08 | 0.5 | 0.52 | 0.4 | 0.79 |
| 2014 | 2.9 | 0.21 | 0.69 | 1.87 | 2.27 | 1.07 |
| 2015 | 4 | 1.2 | 0.43 | 0.69 | 0.33 | 1.43 |
| 2005-2015 | 4.3 | 1.19 | 0.63 | 0.35 | 0.33 | 0.41 |

In line with the global results, the findings show that the youth cohort (aged 15-24) has experienced low and stagnant employment elasticities in Turkey. Youths, especially female youths, are the most disadvantageous group in the Turkish labour market and the share of young people from economic growth is insufficient. While the youth cohort (aged 15-24) has experienced low employment elasticity for the period of 2005-2015, a slightly increasing in employment elasticities observed after the post-crisis period. Very low youth employment elasticity indicates that the employment intensity of economic growth for the youth population is insufficient. While the increase in youth employment was negative during the 2005-2008 period, it turned positive after the 2009 crisis. In Turkey, participation in the labour market among youth has increased from 37.7% in 2005 to 42% in 2015 and 43% in 2018. Economic growth has been more employment-intensive for youth in Turkey after the 2009 crisis. Youth unemployment rates have risen over the period from

While female employment elasticities have exceeded male elasticities, young female elasticities are found lower than male. Kapsos (2015) stated that higher female elasticities could also be indicative of greater relative responsiveness of female employment to both economic growth and economic contraction, whereby women suffer more than men in terms of employment lost during economic downturns. Higher employment elasticity for women can be explained by gender-based segregation of occupations. In this context, women may tend to be engaged in lower-wage and lower-productivity (i.e.

lower quality) jobs. Another explanation of gender gap in the elasticities is the highest gender gap in labour force participation, implying that the higher elasticities likely reflect a “catching-up” in terms of participation among women. Although the labour force participation rate of women, rose from 23% in 2005 to 31% in 2015, it is far below the men in Turkey (TurkStat, 2018b). The results also indicate the additional worker effect for women in the 2009 crisis where greater employment provided for women.

5.CONCLUSION

This study has utilized the employment elasticity as a tool for detecting broad trends in employment generation, productivity growth, and structural economic change over the period 2005 to 2015 for Turkey. In order to provide more detailed evidence on trends, employment intensity was analysed by age group, gender, three main economic sectors (agriculture, industry and services).

The employment elasticity trends in Turkey show a degree of volatility and inconsistency over the period of 2005-2015. During the aforementioned period, while the average economic growth is 4.3%, the employment intensity growth is found 0.85. Turkey experienced relatively more employment-intensive (lower productivity) growth. This implies that around only 0.2% economic growth realized between 2005 and 2015 can be attributed to gains in productivity.

Moreover, the figures are indicative of an ongoing structural movement from the agricultural sector to toward industry, construction and service sectors Turkey. Over the period of 2005-2015, employment intensity of agricultural sector is found -0.53. This result indicates the shrinking of the employment share of the sector. Economic growth of the agricultural sector is based on productivity rather than creating employment. The reduction of the employment raised the discussion of jobless growth in the agricultural sector. The industry and construction sectors have experienced employment growth over the full period, the elasticity of industry (1.38) and construction (1.03) employment to GDP was larger than services (0.68). The findings indicate that during the economic development of Turkey the labour supply in the agricultural sector flows to the manufacture, construction and service sectors, respectively. The changing relationship between economic growth, employment and productivity are obvious after the economic crisis.

The results also show that the youth cohort (aged 15-24) has experienced low and stagnant employment elasticities in Turkey. Very low youth employment elasticity indicates that the employment intensity of economic growth for the youth population is insufficient and that in order to avoid a substantial increase in the number of unemployed youth, Turkish economy will need to develop plans for translating economic growth into employment gains for their young labour force entrants. Yet, higher female elasticities could also be indicative of greater relative responsiveness of female employment to

both economic growth and economic contraction, whereby women suffer more than men in terms of employment lost during economic downturns.

REFERENCES

- Basu, D. and Das, D. (2015) "Employment Elasticity in India and the U.S., 1977-2011: A Sectoral Decomposition Analysis" Economics Department Working Paper Series. 190. Retrieved from https://scholarworks.umass.edu/econ_workingpaper/190 (20.12.2018).
- Kahn, A. (2001) "Employment Policies for Poverty Reduction". Recovery and Reconstruction Department, Discussion paper 1, Geneva, ILO.
- Kapsos, S. (2005), "The Employment Intensity of Growth: Trends and Macroeconomic Determinants", Employment Strategy Papers, No.12 Geneva, ILO.
- Karagöl, E.T. and Akgeyik, T. (2010) "Türkiye'de İstihdam Durumu: Genel Eğilimler", Seta Analiz, (21), 1-28, <http://www.setav.org/ups/dosya/35324.pdf>, (18.10.2018).
- ILO (2005a) "World Employment Report Employment, Productivity And Poverty Reduction" 2004/05. Geneva, ILO, <https://www.ilo.org/public/libdoc/ilo/P/09465/09465%282004-2005%29272.pdf> (20.12.2018).
- TurkStat (2018a) National Accounts, http://www.turkstat.gov.tr/PreTablo.do?alt_id=1108, (02.11.2018)
- TurkStat (2018b) Labour Force Statistics, http://www.turkstat.gov.tr/PreTablo.do?alt_id=1007, (02.11.2018)
- TurkStat (2018c) Explanations Related to the Revisions of Household Labour Force Survey Data https://biruni.tuik.gov.tr/isgucuapp/aciklama/aciklama_veri_tabani_ing.htm;jsessionid=NvQ4UG_pc6lHrFB4ICogJCeU, (03.11.2018)

**FİNANSAL OKURYAZARLIK DÜZEYİNİN BELİRLENMESİ İÇİN COĞRAFI AĞIRLIKLI
REGRESYON YÖNTEMİNİN UYGULANMASI**

Prof. Dr. Üstün ÖZEN*

Dr. Öğr Üyesi Handan ÇAM**

Dr. Öğr Üyesi Fulya ASLAY***

Doç. Dr. Alper Veli ÇAM****

ÖZET

Bireylerin finansal okuryazarlık düzeyi, onların finansal kararlarının başarısına doğrudan etki etmektedir. Finansal okuryazarlık kişinin belli bir dönemde elde ettiği gelirini etkin bir şekilde yönetebilmesini ifade etmektedir. Bu sebeple özellikle bölgesel bazda bireylerin finansal okuryazarlık düzeylerinin tespit edilmesi finansal farkındalık açısından önem arz etmektedir. Bu bağlamda çalışmanın amacı; finansal okuryazarlığın alt parametreleri olan; finansal bilgi, finansal davranış, finansal tutum ve finansal katılım dikkate alarak elde edilen denklemi mekânsal regresyon yardımıyla analiz etmektir. Çalışma kapsamında Doğu Karadeniz Bölgesinde yer alan bazı illerde yaşayan aylık sürekli, belli bir geliri olan 690 kişi örnekleme dahil edilmiştir. Katılımcılara, OECD (Ekonomik İşbirliği ve Kalkınma Örgütü) tarafından geliştirilen ve her yıl OECD ülkelerinde finansal okuryazarlığı ölçmek amacıyla kullanılan ölçek, anket yöntemi ile uygulanmıştır. Ayrıca her bireyin verdiği cevaplar dikkate alınarak her il için belli bir finansal okuryazarlık puanı hesaplanmıştır. Elde edilen değişkenler ile coğrafi ağırlıklı regresyon modeli doğrultusunda her ilin ayrı ayrı finansal okuryazarlık düzeyi hesaplanarak haritalandırılmıştır. Ortaya koyulan haritalar, bölgesel bazda uygulanacak politikaların ve uygulanacak finansal eğitimlerin altyapısını oluşturacaktır.

Anahtar Kelimeler: *Finansal Okuryazarlık; Coğrafi Bilgi Sistemleri; Mekansal Regresyon.*

JEL Kodları: *C89, C91. I22*

* Atatürk Üniversitesi, YBS Bölümü, Erzurum, Türkiye, ustun@atauni.edu.tr

** Gümüşhane Üniversitesi, YBS Bölümü, Gümüşhane, Türkiye, hcam@gumushane.edu.tr

*** Erzincan Binali Yıldırım Üniversitesi, Bilgisayar Mühendisliği Bölümü, Erzincan, Türkiye, fyalcin@erzincan.edu.tr

**** Gümüşhane Üniversitesi, İşletme Bölümü, Gümüşhane, Türkiye, alpercam@gumushane.edu.tr

**APPLICATION OF GEOGRAPHICALLY WEIGHTED REGRESSION TO DETERMINE
THE LEVEL OF FINANCIAL LITERACY**

ABSTRACT

The financial literacy level of individuals has a direct impact on the success of their financial decisions. Financial literacy means that one can effectively manage the income he or she has earned in a certain period. For this reason, it is important to determine the financial literacy levels of individuals on a regional basis, in terms of financial awareness. In this context, the aim of the study is to analyze the equation obtained by considering financial information, financial behavior, financial attitudes and financial participation which are sub parameters of financial literacy, with the help of spatial regression. In the scope of the study, the sample consists of 690 people, who live in some of the provinces located in the Eastern Black Sea Region, and have a certain monthly income every month. Participants were asked to respond to a scale developed by the OECD and used annually in OECD countries to measure financial literacy. In addition, a certain financial literacy score was calculated for each province considering the answers given. Financial literacy level of each province has been calculated and mapped with the obtained variables, using the geographical weighted regression model. The resulting maps will form the infrastructure for the policies and the financial training to be implemented, on a regional basis.

Keywords: *Financial literacy; Geographical Information Systems; Spatial Regression.*

JEL Codes: *C89, C91, I22*

1. GİRİŞ

Finansal okuryazarlık bireyin doğru finansal kararlar verebilmesi için gerekli bilgiye sahip olmasıdır. Finansal okuryazar, gelirini en verimli şekilde değerlendirerek doğru yatırım yapabilen ve tasarruf kararları alabilen kişidir. Finans alanında eğitim almış kişilerin bile karmaşık finans dünyasında zaman zaman doğru kararlar almakta zorlandıkları göz önünde bulundurulduğunda bireysel anlamda finansal okuryazarlığa sahip olmanın önemi ortaya çıkmaktadır. Ayrıca küresel anlamda tüm gelişmiş ve gelişmekte olan ülkelerin dahi yaşadığı finansal krizler düşünüldüğünde bireylerin bu ortamdaki en az etkilenmeleri için finansal bilgiye sahip olmaları gerekmektedir. Özellikle OECD ülkeleri ve OECD dışındaki ülkelere yapılan araştırmalar incelendiğinde, bireylerin çok az finansal bilgiye sahip oldukları ve bunun finansal kararlarını etkilediği görülmektedir.

Tüketicilerin bilinçli olarak paralarını kullanmalarının ve yönetmelerinin önce bireye sonra da toplumsal anlamda ülke ekonomisine katkı sağlayacağı yadsınamaz bir gerçektir. Bu sebeple tüketicilerin finansal okuryazarlıklarının yüksek olması için bilgilendirilmeleri, ayrıca farkındalık oluşturarak çeşitli eğitimlerle desteklenmeleri onlar için faydalı olacaktır.

Bu çalışmada; finansal bilgi, finansal davranış, finansal tutum ve finansal katılım gibi parametrelerin finansal okuryazarlık üzerindeki etkisi mekânsal regresyon analizi yardımıyla incelenmektedir. Çalışma kapsamında Doğu Karadeniz Bölgesi'nde yer alan Trabzon, Rize, Gümüşhane, Giresun, Artvin ve Bayburt illerinde ikamet eden aylık sürekli, belli bir geliri olan 690 kişiye OECD tarafından geliştirilen ve her yıl OECD ülkelerinde finansal okuryazarlığı ölçmek amacıyla kullanılan ölçek, anket yöntemi ile uygulanmıştır. Veri seti ArcGIS10.3 programı yardımıyla analiz edilerek sonuçlar literatüre paralel yorumlanmıştır.

2.LİTERATÜR ÖZETİ

Literatürde finansal okuryazarlığın belirlenmesine yönelik çalışmalar ile CBS yöntemlerinin çeşitli alanlarda uygulamalarına yönelik çalışmalara ait literatür özeti Tablo 1'de sunulmuştur.

Tablo 1. Literatür Özeti

| Yazarlar | Yıl | Konu | Yöntem |
|-------------------------|------|-----------------------|---------------------|
| Danes ve Hira | 1987 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Markovich ve DeVaney | 1997 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Hogarth | 2002 | Finansal Okuryazarlık | True/False |
| Chen ve Volpe | 2002 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Volpe vd. | 2002 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Beal ve Delpachitra | 2003 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Worthington | 2006 | Finansal Okuryazarlık | Logit Regresyon |
| Lusardi ve Mitchell | 2007 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Lusardi | 2008 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Al-Tamimi ve Kalli | 2009 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Pahnke ve Honekamp | 2010 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Rooij vd. 2007 | 2011 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Shaari vd. | 2013 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Mahdzan ve Tabiani | 2013 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Duca ve Kumar | 2014 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Çam ve Barut | 2015 | Finansal Okuryazarlık | Doğrusal Regresyon |
| Cihangir ve Ergin | 2015 | Finansal Bilgi | Doğrusal Regresyon |
| Albeerdly ve Gharlegghi | 2015 | Finansal Okuryazarlık | Pearson Korelasyon |
| Zeybek vd. | 2017 | Finansal Risk | Mekansal Regresyon |
| Çelik | 2017 | Teşvik Politikası | Mekansal Regresyon |
| Baktemur ve Özmen | 2017 | İşsizlik | Mekansal Ekonometri |

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | | |
|------------|------|------------------|--------------------|
| Akıncı vd. | 2017 | Sosyal Ekonomi | Mekansal Regresyon |
| Çam vd. | 2018 | Finansal Katılım | Doğrusal Regresyon |

Finansal okuryazarlığın belirlenmesi ile ilgili çalışmalarda daha çok örneklem kütesinin finansal okuryazarlık düzeyleri ortaya çıkarılmaya çalışılmıştır.

3. METODOLOJİ

3.1. Araştırmanın Amacı

OECD tarafından finansal okuryazarlık düzeyini ölçmek amacıyla kullanılan ölçek dikkate alınarak finansal bilgi, finansal tutum, finansal davranış olmak üzere üç farklı parametre elde edilmiştir. Bu parametrelere finansal katılım da eklenerek finansal okuryazarlık düzeyi coğrafi ağırlıklı regresyon yöntemiyle analiz edilmiştir. Çalışmanın amacı; belirlenen doğu Karadeniz Bölgesindeki illerin finansal okuryazarlık düzeylerinin belirlenerek elde edilen sonuca istinaden çeşitli öngörülerde bulunmaktır. Kullanılan analizin mekânsal farkı dikkate alınmasından dolayı illerin mekana bağlı, elde edilen parametrelerle açıklanan finansal okuryazarlık düzeylerinin tespiti ana amacı oluşturmaktadır.

3.2. Araştırmanın Değişkenleri

Bireylerin gelirlerini, tasarruflarını, harcamalarını ve borçlarını yönetebilmek için kararlar alma yeteneği (Moore, 2003: 4; Mandell, 2007: 164; Lusardi ve Mitchell, 2007: 206) olarak ifade edilen finansal okuryazarlık; finansal davranış, finansal tutum, finansal bilgi ve finansal katılımın bir çıktısıdır. Bireylerin finansal okuryazarlık düzeyleri bu alt parametrelerdeki değişikliklere göre şekillenmektedir. Bu bağlamda çalışmada bireylerin finansal okuryazarlık düzeyleri, OECD ölçeği kapsamında hesaplanan finansal davranış, finansal tutum, finansal bilgi ve finansal katılım skorlarının aritmetik ortalaması alınarak hesaplanmıştır.

Bireylerin finansal davranış düzeylerini belirlemek için kullanılan değişkenler Tablo 2'de sunulmuştur.

Tablo 2. Finansal Davranış Alt Değişkenleri

| Finansal Davranış Düzeyi Değişkeni | Davranış Skoru |
|--|-----------------------|
| Faturalarımı zamanında öderim | 5-4-3-2-1 |
| Tasarruf ya da yatırım yaparken paramın bir kısmını riske atmaya hazırım. | 5-4-3-2-1 |
| Mali durumumu yakından takip ederim. | 5-4-3-2-1 |
| Uzun vadeli finansal hedefler belirler ve onlara ulaşmaya çalışırım. | 5-4-3-2-1 |
| Bir şey almadan önce maddi gücümün olup olmadığını dikkate alırım | 5-4-3-2-1 |
| Finansal durumum, benim için önemli olan şeyleri yapmada beni sınırlandırır. | 1-2-3-4-5 |
| Asgari yaşam giderlerimi ödemede endişe duyuyorum. | 1-2-3-4-5 |

Bu değişkenlere ait Likert ölçeğine göre hazırlanmış cevap şıklarından bireylerin vermiş olduğu cevaplara göre 1 ile 5 arasında puanlama yapılmıştır.

Bireylerin finansal bilgi düzeylerinin belirlenebilmesi için 5 adet soru yöneltilmiştir. Basit bölme, enflasyon, bileşik faiz, yüksek getiri ve risk hesaplamalarını içeren sorulara verilen doğru cevap sayılarına göre bireylerin finansal bilgi skorları 0 ile 5 puan aralığında hesaplanmıştır.

Bireylerin finansal tutum düzeylerini belirlemek için kullanılan değişkenler Tablo 3'de sunulmuştur.

Tablo 3. Finansal Tutum Alt Değişkeni

| Finansal Tutum Düzeyi Değişkenleri | Tutum Puanı |
|--|--------------------|
| Para harcamak içindir. | 1-2-3-4-5 |
| Bugün için yaşar, yarın için endişelenmem. | 1-2-3-4-5 |
| Parayı harcamak beni, uzun vadede tasarruf etmeden daha fazla tatmin eder. | 1-2-3-4-5 |

Bu değişkenlere ait Likert ölçeğine göre hazırlanmış cevap şıklarından bireylerin vermiş olduğu cevaplara göre 1 ile 5 arasında puanlama yapılmıştır.

Bireylerin finansal katılım düzeyinin hesaplanabilmesi için bireylere 9 adet finansal araçtan hangilerine sahip olduklarını belirtmeleri istenmiştir. Bu finanslar araçlar sırasıyla; bireysel emeklilik fonu, yatırım hesabı, konut kredisi, banka kredisi, kredi kartı, altın hesabı, tasarruf hesabı, zorunlu olmayan sigorta, hisse senedi ve tahvildir. Bu finansal araçlardan 8-9 adetine sahip olanlara 5 puan, 6-7 adetine sahip olanlara 4 puan, 4-5 adetine sahip olanlara 3 puan, 2-3 adetine sahip olanlara 2 puan, 1 adetine sahip olan veya hiç finansal araca sahip olmayanlara 1 puan verilmiştir.

3.3. Örneklem Süreci ve Analiz Yöntemi

Araştırmanın örneklemini Doğu Karadeniz Bölgesinde yer alan Trabzon, Ordu, Rize, Giresun, Gümüşhane ve Artvin'de yer alan aylık sürekli geliri olan bireyler oluşturmaktadır. Örnekleme hacmi illerin nüfusuna göre ağırlıklandırılarak hesaplanmıştır. Toplamda 690 kişi anakütleden örnekleme dâhil edilmiştir. Örnekleme yer alan katılımcılara OECD tarafından finansal okuryazarlık düzeyini ölçmek amacıyla kullanılan ölçek yüzyüze anket metoduyla uygulanmıştır.

Coğrafi açıdan birbirinden farklı olan bölgeler, kültürel, sosyal ve ekonomik açıdan da birbirinden farklı özellikler göstermektedir. Genel olarak basit doğrusal regresyon modellerinde bu coğrafi birim farkı dikkate alınmamaktadır. Son dönemlerde coğrafi ağırlıklı regresyon (CAR) modelleri vasıtasıyla doğrusal regresyon modellerinde gözard edilen lokasyon farkı modellere dâhil edilerek daha isabetli tahminler yapılabilmektedir. CAR ile kurulan modellerde değişkenlerin lokasyon farkları da yer alarak aşağıdaki denklem ile gösterilmektedir.

$$Y_i = \beta_{0i} + \sum_{k=1}^n \beta_{ik} X_{ik} + U_i \quad (1)$$

β_{ik} , tüm $i=1,2,\dots,n$ için sabit olduğunda klasik basit regresyon modeli geçerlidir (Brunsdon, Fotheringham ve Charlton, 1996: 285). i , birime ait lokasyon değeri ise şu şekilde gösterilir.

$$B_i = 1/(XW_iX)XW_{iy} \quad (2)$$

W_i, W_{ij} ($j=1,2,\dots,n$)'lerden oluşan $(n \times n)$ boyutlu diyagonal ağırlık matrisidir. CAR'daki ağırlıklar i . birimin konumuna göre değişmektedir ve ağırlık matrisi her bir i için hesaplanmaktadır. Denklemler incelendiğinde, doğrusal regresyon modeli sonucu elde edilen regresyon katsayısı global bir değer ve tahmin içine alınan tüm değişkenler için sabittir. Doğrusal regresyon modelinin içine coğrafi ve lokal regresyon değerlerini Brunsdon 1996'da dahil ederek CAR modelini geliştirmiştir.

4. BULGULAR

4.1. Demografik Bulgular

Örneklemin demografik yapısı analiz sonuçları Tablo 4'de görülmektedir. Örnekleme 20 ile 49 yaş aralığında olan sürekli bir gelire sahip kişiler çoğunlukla dâhil edilmiştir. Kişisel gelirler tüm aralıklarda yer alırken örneklemin %55,6'sının kişi başı milli gelirin altında kaldığı görülmektedir. Araştırma yapılan illerden nüfuslarına göre tabakalama yapılarak orantılı bir şekilde örnekleme katılımcı dâhil edilmiştir. Bu bağlamda en çok katılım nüfusuyla doğru orantılı olarak Trabzon ilinden olmuştur.

Tablo 4. Örneklemin Demografik Yapısı

| Cinsiyet | Frekans(f) | Yüzde(%) | Yaş | Frekans(f) | Yüzde (%) |
|-------------------------------|-------------------|-----------------|----------------------|-------------------|------------------|
| Erkek | 430 | 62,3 | 18-19 | 25 | 3,6 |
| Kadın | 260 | 37,7 | 20-29 | 286 | 41,4 |
| Medeni Durum | Frekans(f) | Yüzde(%) | 30-39 | 199 | 28,8 |
| Evli | 371 | 53,8 | 40-49 | 101 | 14,6 |
| Bekâr | 319 | 46,2 | 50-59 | 60 | 8,7 |
| | | | 60-69 | 18 | 2,6 |
| | | | 70 ve üstü | 1 | 0,1 |
| Meslek | Frekans(f) | Yüzde(%) | Kişisel Gelir | Frekans(f) | Yüzde (%) |
| Esnaf | 157 | 22,8 | 0-1000 | 83 | 12,0 |
| Memur | 126 | 18,3 | 1001-1500 | 169 | 24,5 |
| İşçi | 175 | 25,4 | 1501-2000 | 136 | 19,7 |
| Serbest meslek | 51 | 7,4 | 2001-2500 | 99 | 14,3 |
| Emekli | 23 | 3,3 | 2501-3000 | 49 | 7,1 |
| Çiftçi | 13 | 1,9 | 3001-3500 | 74 | 10,7 |
| Diğer | 145 | 21,0 | 3501-4000 | 28 | 4,1 |
| | | | 4000 ve üzeri | 52 | 7,5 |
| Ekonomik Grup Dağılımı | Frekans(f) | Yüzde(%) | Yaşadığı İl | Frekans(f) | Yüzde (%) |
| KBMG Altı | 385 | 55,8 | Trabzon | 180 | 26,0878 |
| KBMG Seviyesi | 150 | 21,7 | Ordu | 155 | 22,4637 |
| KBMG Üstü | 155 | 22,5 | Giresun | 115 | 16,666 |
| | | | Rize | 95 | 13,7681 |
| | | | Artvin | 80 | 11,5942 |
| | | | Gümüşhane | 65 | 9,4202 |

KBMG: Kişibaşı Milli Gelir

4.2. Coğrafi Ağırlıklı Regresyon Analiz Bulguları

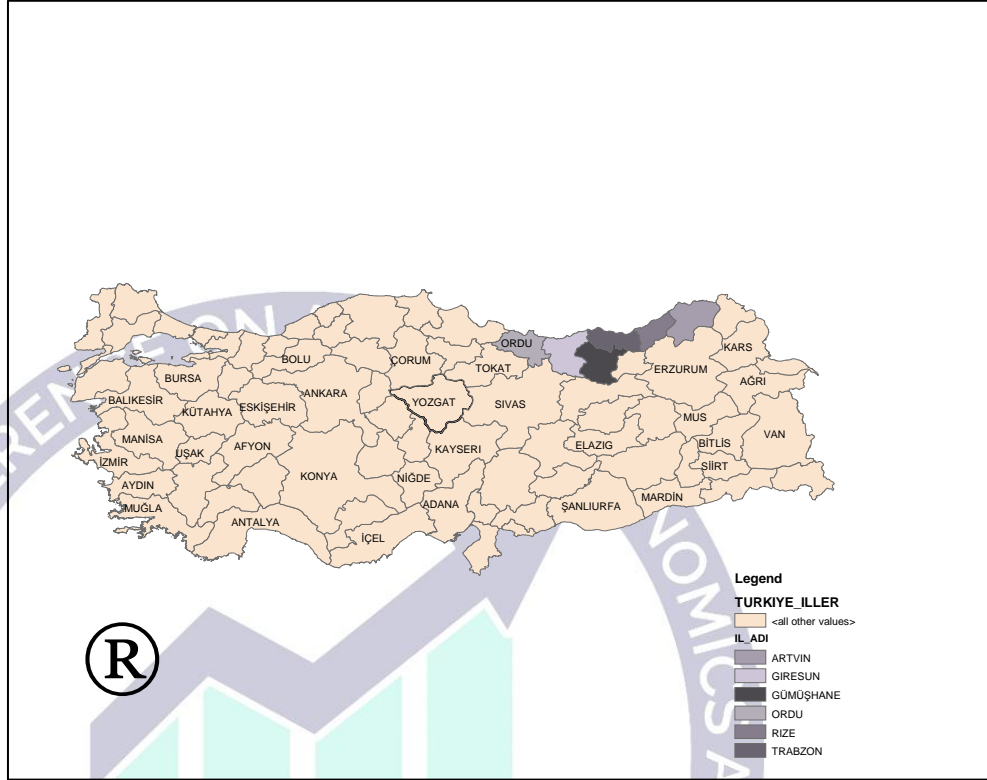
Finansal okuryazarlık bağımlı değişkeni, finansal katılım, finansal bilgi, finansal tutum, finansal davranış bağımsız değişkenleri tarafından %93,9 oranında açıklanmaktadır (Tablo % 5) Fotheringham, Brunson ve Charlton (2002) Kernel' Car modelinde yer alan verilerin birbirine göre ağırlıklandırılmasının yapıldığı bir teknik olarak adlandırmaktadır. Kernel ayarlanabilir ve sabit olmak üzere iki yöntemle verileri ağırlıklandırmaktadır. Uyarlanabilir Kernel verilerin yoğun olduğu bölgelerle yoğun olmadığı bölgelerde farklı bant genişlikleri kullanarak hata oranını en az orana indirmektedir. Bu nedenle çalışmada uyarlanabilir Kernel yapısı kullanılmıştır. Uyarlanabilir Kernel yapısında AICc ve CV yöntemleri kullanılmaktadır. Fakat AICc yöntemi karmaşık CAR model yapısında en elverişli yöntem olarak geniş bir kullanım alanına sahiptir (Fotheringham vd, 2002). Bu nedenle araştırmada

AICc yöntemi kullanılmıştır. AICc değerinin -116,022 olduğu görülmektedir. CAR modellerinde AICc değerinin düşük olması modelin anlamlılığını ve etkinlik gücünün yüksek olduğunu göstermektedir. Elde edilen CAR modelinin AICc değeri istenildiği gibi oldukça düşük bir değere sahiptir. $P=0,000$ ve $Z= 7,426644$ değerleri modelin anlamlılığını ortaya koymaktadır. Diğer CAR katsayısı ise Moran indeksi, klasik korelasyonda olduğu gibi otokorelasyonu göstermektedir. Tek farkı mekânsal otokorelasyonu göstermesidir. + ile – arasında değerler almaktadır. Moran indeksi artı veya eksi değerler alabilir ve pozitif ve negatif otokorelasyondan bahsedilir. Eğer bu değer sıfır ise verilerin rastgele bir yapıya sahip olduğu düşünülebilir (Iqbal vd. 2005; Rogerson, 2001). Tablo 5’ de Moran indeksin 0,284481 olduğu görülmektedir.

Tablo 5. CAR model Katsayı ve Mekansal Otokorelasyon Değerleri

| Bağımlı Değişken | Finansal Okuryazarlık |
|-----------------------------|---|
| Bağımsız Değişkenler | Finansal Katılım, Finansal Bilgi, Finansal Tutum, Finansal Davranış |
| Kernel | Adaptive |
| Band genişliği | AICc |
| P değeri | 0,000 |
| AICc | -116,022 |
| R-kare | 0,939 |
| Düzeltilmiş R-kare | 0,92460 |
| Moran İndeks Değeri | 0,284481 |
| Z değeri | 7,426644 |
| Variance Değeri | 0,0015 |
| Sigma Değeri | 0,10888 |

Extended With
Social Sciences



Şekil 1’de görüldüğü üzere Doğu Karadeniz bölgesinde yer alan altı ilin finansal okuryazarlık düzeyini göstermektedir. Harita dikkate alındığında Gümüşhane en yüksek finansal okuryazarlık düzeyine sahip, ikinci sırada Trabzon, Rize ve Artvin’in finansal okuryazarlık düzeyi görülürken en düşük Giresun ve Ordu illerinin finansal okuryazarlık düzeyine sahip oldukları tespit edilmiştir.

5. TARTIŞMA VE SONUÇ

Bireylerin finansal bilgi, finansal tutum, finansal davranış ve finansal katılım düzeyleri, finansal okuryazarlık düzeyini belirlemektedir. Finansal okuryazarlık düzeyi artan bireylerin finansal maliyetleri düşürmesi, kâr düzeylerini arttırması ve bilinçli yatırım kararları alması beklenmektedir. Çalışmada Doğu Karadeniz bölgesindeki illerde çalışan bireylerin finansal okuryazarlık skorları OECD tarafından geliştirilen ölçekle elde edilmiştir. Elde edilen veriler coğrafi ağırlıklı regresyon yöntemi ile analiz edilmiştir ve Şekil 1’de gösterilen harita elde edilmiştir. Ortaya çıkan haritaya göre iller arasında en yüksek finansal okuryazarlık düzeyinin Gümüşhane ve Trabzon iline ait olduğu ortaya çıkmıştır. En düşük finansal okuryazarlık düzeyi ise Giresun ve Ordu illeridir. Klasik yöntemle göre finansal okuryazarlık düzeyleri incelendiğinde ise Artvin ve Giresun illeri yüksek skora sahipken, Rize ve Ordu

illeri düşük skora sahiptir. İki yöntem arasındaki farklılığın temel sebebi, mekânsal ağırlığın etkisidir. Çünkü tüm bölgenin mekânsal ağırlık değerlerinin farklı olması parametre değerleri etkileyerek yeni bir skor ortaya koymaktadır. Bu çalışma, CBS yöntemlerinin finans alanında bir uygulaması niteliğindedir. Finansal okuryazarlık düzeylerinin artırılması için alınacak olan tedbirler ve verilecek olan eğitimler elde edilen klasik sonuçlara göre şekillenmektedir. Bu sebeple klasik yöntemler dışında, CBS yöntemleri kullanılarak yapılacak olan tespitler karar vericiler için farklı bakış açıları kazandırabilir. Bölgesel bazda gerçekleştirilen bu çalışma ülke bazında gerçekleştirilerek, makro düzeyde alınacak tedbirler çeşitlendirilebilir.

KAYNAKÇA

- Akıncı, M., Akıncı, G.Y ve Yılmaz, Ö. (2017) “Dramın Boyutlarının Ölçümü: Terörizmin Sosyo-Ekonomik Belirleyicilerinin Coğrafi Ağırlıklı Regresyon Analizi”, *Fiscaoeconomia*, 1(3): 68-107.
- Alberdy, M. ve Gharleghi, B. (2015) “Determinants of The Financial Literacy Among College Students in Malaysia” *International Journal of Business Administration*. 6(3): 15-24.
- Al-Tamimi, H.A.H. ve Bin Kalli, A.A. (2009) “Financial Literacy and Investment Decisions of UAE Investors”, *Journal of Risk Finance*. 10(5): 500-516.
- Beal, D. ve Delpachitra. S. (2003) “Financial Literacy Among Australian University Students” *Economic Papers: A Journal of Applied Economics and Policy*. 22(1): 65-78.
- Baktemur, F.İ. ve Özmen, M. (2017) “Gelişmiş AB Ülkeleri için İşsizlik Yakınsamasının Mekansal Ekonometrik Analizi”, *Finans Politik & Ekonomik Yorumlar*, 54(626): 33-45.
- Brunsdon, C., Fotheringham, A. S. ve Charlton, M. E. (1996) “Geographically Weighted Regression: A Method for Exploring Spatial Nonstationarity”, *Geographical Analysis*, 28(4): 281-298.
- Chen, H. ve Volpe, R.P. (2002) “Gender Differences in Personal Financial Literacy Among College Students”, *Financial Services Review*, 11(3): 289-307.
- Cihangir, M. ve Ergin, E. (2015) “Finansal Okuryazarlığın Temel Düzeyde İncelenmesi: Osmaniye İlinde Ankete Dayalı Bir Araştırma”, *Akademik Sosyal Araştırmalar Dergisi*, 3(13): 492-511.
- Çam, A.V. ve Barut, A. (2015) “Finansal Okuryazarlık Düzeyi ve Davranışları: Gümüşhane Üniversitesi Önlisans Öğrencileri Üzerinde Bir Araştırma”, *Küresel İktisat ve İşletme Çalışmaları Dergisi*. 4(7): 63-72.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Çam, H., Ayaydın, H., Çam, A.V. ve Akdeniz, F. (2018) “Bireylerin Finansal Bilgi Düzeyi ile Finansal Katılım Düzeyi Arasındaki İlişki: TR90 Bölgesinde Bir Araştırma”, *Ekonomi Bilimleri Dergisi*. 10(1): 1-13.
- Çelik, N. (2017) “Teşvik Politikalarının Etkinliğinin Mekansal Perspektiften Değerlendirilmesi”, *Ege Akademik Bakış*, 17(1): 1-12.
- Danes, S. M. ve Hira, T. K. (1987) “Money Management Knowledge of College Students”, *The Journal of Student Financial Aid*. 17: 4–16.
- Duca, J. ve Kumar, A. (2014) “Financial Literacy and Mortgage Equity Withdrawals”, *Journal of Urban Economics*”, 80: 62-75.
- Fotheringham, A. S., Brunson, D., Charlton, M. (2002). *Geographically Weighted Regression: The Analysis of Spatially Varying Relationship*. John Wiley and Sons LTD, University of Newcastle, Newcastle.
- Hogarth, J.M. (2002). “Financial Literacy and Family and Consumer Sciences”, *Journal of Family and Consumer Sciences*. 94: 15-28.
- Iqbal J., Thomasson J.A., Jenkins J.N. Owens P.R. ve Whisler FD. (2005) “Spatial Variability Analysis of Soil Physical Properties of Alluvial Soils”, *Soil Science Society of America Journal* 69: 1338-1350.
- Lusardi, A. ve Mitchell, O. S. (2007) “Baby Boomer Retirement Security: The Roles of Planning, Financial Literacy and Housing Wealth”, *Journal of Monetary Economics*. 54: 205-224.
- Lusardi, A. (2008). “Financial Literacy: An Essential Tool for Informed Consumer Choice”, *National Bureau of Economic Research*, 1-29.
- Mahdzan, N. S. ve Tabiani, S. (2013) “The Impact of Financial Literacy on Individual Saving: An Exploratory Study in The Malaysian Context”, *Transformation in Business & Economics*, 12(1): 41-55.
- Mandell, L. (2007) “Financial Literacy of High School Students”, Xiao J.J. (ed) *Handbook of Consumer Finance Research*, New York: Springer.
- Markovich, C. A. ve Devaney, S. A. (1997) “College Seniors’ Personal Finance Knowledge and Practices”, *Journal of Family and Consumer Sciences*. 89: 61–65.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Moore, D. (2003). "Survey of Financial Literacy in Washington State: Knowledge, Behavior, Attitudes and Experiences", Technical Report. Social and Economic Sciences Research Center, Washington State University.
- Pahnke, L. ve Honekamp, I. (2010) "Different Effects of Financial Literacy and Financial Education in Germany", Bitirme Tezi, Chair in Economics, Especially Empirical Microeconomics, University of Bamberg.
- Rogerson, A. P. (2001) "Statistical Methods for Geography", London: Sage Publications.
- Rooij, M.V., Lusardi, A. ve Alessie R. (2007) "Financial Literacy and Stock Market Participation", Journal of Financial Economics, 101(2): 449-472.
- Shaari, N.A., Hasan, N.A., Mohamed, R., Kumar, M.H., Sabri, M. ve Ahmad, J. M. (2013) "Financial Literacy: A Study among the University Students", Interdisciplinary Journal of Contemporary Research in Business. 5(2): 279-299.
- Worthington, A.C. (2006) "Predicting Financial Literacy in Australia. Financial Services Review", 15(1): 59-79.
- Volpe, R.P., Kotel, J.E. ve Chen, H. (2002) "A Survey of Investment Literacy Among Online Investors", Financial Counseling and Planning. 13(1): 1-13.
- Zeybek, H.İ., Çam H. ve Çam A.V. (2017) "Geographic Information Systems (GIS) Based Financial Risk Map of Turkey", 4 th International Management Information Systems Conference, İstanbul.

**TÜKETİCİLERİN YABANCI MARKALARLA DUYGUSAL BAĞLARI: DÜŞMANLIK,
HAYRANLIK VE ETNOSENTRİZM¹**

Doç. Dr. Hatice AYDIN*

Prof. Dr. Sevtap ÜNAL**

ÖZET

Bu çalışmada tüketicilerin bir ülkeye karşı hissettiği hayranlık, düşmanlık duygularının ve etnosentrizm eğilimlerinin marka imajına ve satın alma niyetine etkisini tespit etmek amaçlanmıştır. Yerli ürün alternatif yokluğunun söz konusu duygular ve satın alma niyeti üzerindeki moderatör etkisi de belirlenmeye çalışılmıştır. Türk tüketicilere 2 Ocak-17 Şubat tarihleri arasında yüzyüze anket uygulanmıştır. Hayranlığın, entosentrizmin satın alma niyetine etkisi anlamlı bulunmuştur. Hayranlığın satın alma niyetine etkisinde alternatif yokluğunun moderatör etkisi ve imajın aracı rolü de tespit edilmiştir.

Anahtar Kelimeler: *Tüketici Hayranlığı, Düşmanlık, Ethnosentrizm, Marka İmajı, Yerli Malı Alternatif Yokluğu.*

Jel Kodları: *M21, M30, M31.*

**CONSUMERS' EMOTIONAL BONDS WITH FOREIGN BRANDS: ANIMOSITY, AFFINITY AND
ENTHOCENTRISM**

ABSTRACT

The purpose of this study is to determine the effect of consumers' affinity, animosity and ethnocentrism towards a country on brand image and purchase intention. The study also attempts to identify the moderation effect of the lack of alternative domestic products on these feelings and purchase intention. Turkish consumers were surveyed through face-to-face interviews. Affinity and ethnocentrism have a significant effect on purchase intention. The lack of alternative has a moderator role and brand image has mediator role in the effect of affinity on purchase intention.

¹ Bu çalışma Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi Bilimsel Araştırma Projeleri Koordinasyon Birimi tarafından desteklenmiştir. Proje No: BAP-18-ÖSUBF-1009-119"

* Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi, Ömer Seyfettin Uygulamalı Bilimler Fakültesi, Balıkesir, Türkiye email: haydin@bandirma.edu.tr.

** İzmir Katip Çelebi Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İzmir, Türkiye email: sevtap.unal@ikc.edu.tr.

Keywords: Consumer Affinity, Animosity, Ethnocentrism, Brand Image, Lack of Availability of Domestic Products.

Jel Codes: M21, M30, M31.

1. GİRİŞ

Tüketici düşmanlığı yabancı bir ülkeye ve o ülke insanlarına antipati duymayı ifade etmektedir (Rose vd., 2009: 331). Tüm yabancı ülkelerin ürünlerini satın almanın ahlaka uygun olmadığını ifade eden tüketici etnosentrismi ise düşmanlık duygusu ile ilişkili kavramlardan biridir (Bawa, 2004: 43). Benzerliklerine rağmen iki duygunun birbirinden farklı yönlerinin olduğu, ayrı yapıyı temsil ettikleri düşünülmektedir (Klein vd., 1998). Aralarındaki temel farklılık, etnosentrismın tüm yabancı ülkelere karşı olumsuz hisleri, düşmanlığın ise belli bir ülkeye ve ürünlerine isteksizliği ifade etmesidir (Nijssen ve Douglas, 2004: 27). Son yıllarda iki duygunun etkinliğini azaltan ve onlara eleştiri olarak geliştirildiği düşünülen duygu “tüketici hayranlığı” olarak karşımıza çıkmaktadır (Amine, 2008: 413). Bu kavram, yabancı bir ülkeyi belirli özelliklerinden dolayı odak noktası kabul etmeyi ve o ülkenin ürün ve markasını almaya istekli olmayı ifade etmektedir (Wongtada vd., 2012: 148).

Yabancı hayranlığı yabancı ülke markalarına karşı algıları olumlu etkilerken (Batra vd., 2000), düşmanlık ve etnosentrism olumsuz etkilemektedir (Fakmanesh ve Miyandehi, 2013: 156). Ülkeyle ilgili duyguların tüketici davranışına etki etmesinin nedenlerinden birinin de yerli malı alternatif yokluğu olduğu düşünülmektedir (Chan vd., 2010: 209). Bazı ürün gruplarında yerli seçeneklerin bulunmamasını ifade eden alternatif yokluğunun, yabancı ülke hayranlığı, düşmanlığı ve etnosentrizminin yabancı ürün satın alma niyeti üzerinde moderator etkisine sahip olduğu düşünülmektedir. Tüketicinin yabancı ülkeye yönelik olumsuz duyguları ve satınalma niyeti ilişkisinde rolü olan bir diğer konu ise marka imajıdır. Tüketiciler bir ülkeye yönelik düşmanca hislere veya etnosentrik eğilime sahip olabilmekte ancak yabancı markanın sahip olduğu güçlü imaj o ürünü almasını sağlayabilmektedir.

Bu çalışmada, tüketicilerin başka bir ülkeye yönelik olumlu ve olumsuz duygularının satın alma niyetine etkisini ve bu ilişkide marka imajının ve alternatif yokluğunun Aracı (mediator) ve düzenleyici (moderator) rollerinin olup olmadığını tespit etmek amaçlanmıştır. Araştırmanın sonuçları itibari ile literatüre katkı sunması beklenmektedir.

2. LİTERATÜR VE HİPOTEZLER

Yabancı ülkeyle ilgili duygular geçmişten beridir araştırılmakta ve genellikle düşmanlık (Rose vd., 2009; Sutikno and Cheng, 2011; Ma vd., 2012; Fakharmanesh ve Miyandehi, 2013) ve etnik

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES**

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

merkezcilik (Sutikno ve Cheng, 2011; Fakhmanesh ve Miyandehi, 2013) şeklinde ele alınmaktadır. Tüketici hayranlığı, geçmişten beridir bazı çalışmalara (Baillargeon, 2003; Nijssen ve Douglas, 2004) konu olsa da, bazı araştırmacılara göre (Oberecker ve Diamantopoulos, 2011; Wongtada vd., 2012) henüz yeni bir olgu olduğu düşünülmekte ve özellikle de son yıllarda önemle üzerinde durulmaktadır. Aşağıda çalışmanın amacı ve literatür dođultusunda hipotezler sunulmuştur:

Düşmanlık, bir ülkeye karşı beslenen antipatik duyguları ifade etmektedir (Klein vd., 1998). Amine vd. (2005), ülkeye olan düşmanlığın ürüne yönelik duygulara dönüştüğünü, zamanla davranışlar üzerinde etkili olduğunu ve tüketicilerin düşman olarak algıladıkları ülkenin ürünlerini alma davranışlarını olumsuz etkilediğini ifade etmiştir.

H1: Tüketici düşmanlığı yabancı menşeli ürünü alma niyetine negatif etki etmektedir.

Tüketici etnosentrizmi, bireyin kendi ülkesini sevmesi, kaygılanması ve yabancı menşeli ürün almaya karşı isteksiz olmasını ifade etmektedir (Sutikno ve Cheng, 2011: 15). Etnosentrizm ile beraber yerli ürün-marka sayısı ve yerli ürün tercih etme eğilimleri artarken yabancı menşeli ürün tercih etme eğilimi azalabilmektedir (Guo ve Zhou, 2017).

H2: Tüketici etnosentrizmi yabancı menşeli ürünü alma niyetine negatif etki etmektedir.

Yabancı ülke hayranlığı, yabancı bir ülkeyi sevmeye ve söz konusu ülkenin ürün ve hizmetlerinden yararlanma isteğini ifade etmektedir (Wongtada vd., 2012: 149). Nes vd.(2014)'e göre tüketici yabancı bir ülkeye hayranlık duyuyorsa ülkeyle duygusal yakınlığını sürdürmek için ülkenin ürün ve markalarını satın almaya devam edecektir.

H3: Tüketici hayranlığı yabancı marka ürünü yeniden alma niyetine negatif etki etmektedir.

Marka imajı, müşterinin zihninde marka ile ilgili bir canlanma, markaya dair algılar, markanın çağrıştırdığı duygu, düşünce ve inançlar bütünüdür (Koubaa, 2008:140). Marka imajı, bir markayı satın alma niyetine etki etmektedir (Fakhmanesh and Miyandehi, 2013; 155). Tüketicide negatif duygular hakim olmasına karşın yabancı ülke ürünü ile ilgili olumlu imaja sahip ise olumsuz duygular hissedilmesine karşın satın alma niyeti söz konusu olabilir.

H4: Marka imajı, düşmanlığın yeniden satınalma niyetine etkisinde aracı role sahiptir,

H5: Marka imajı, etnosentrizmin yeniden satınalma niyetine etkisinde aracı role sahiptir,

H6: Marka imajı, hayranlığın yeniden satınalma niyetine etkisinde aracı role sahiptir,

Bir ülkede bazı ürün gruplarında alternatif marka mevcutken bazı ürün gruplarında alternatif bulunmamaktadır. Tüketici, yabancı ülkeye karşı ırkçı duygulara sahip olsa da yerli ürün ve marka

4. ARAŞTIRMA SONUÇLARI

4.1. Demografik Özellikler ve Tanımlayıcı İstatistikler

Araştırmaya katılanların çoğu bekar (54,6), erkek (50,1), özel sektör çalışanı (20,3), 29-39 yaş aralığında (36,6), yüksek eğitime sahip (79,7) orta gelirli (27,9) tüketicilerdir.

4.2. Ölçeklerin Güvenirlilik ve Geçerlilik Analizi Sonuçları

Araştırmada kullanılan ölçeklerin güvenilirlik ve geçerlilik analizleri yapılmış, güvenilirlik için içsel tutarlılık ölçütü olan ve en az 0,70 olması gereken alfa katsayısından faydalanılmıştır (Hair vd., 1998: 118). Geçerliliği belirlemede yapı geçerliliğinden yararlanılmıştır. Geçerlilik için yapılar ait güvenilirlik değeri 0,70'i ve ölçme modelindeki her yapının değeri 0,50'yi aşmalıdır. Ayrıca yapılar arası korelasyon değerlerinin, her yapının AVE değerinin karekökünden ve MSV değeri AVE değerinden küçük olmalıdır (Hair vd., 2010: 691). Güvenirlilik ve geçerlilik sonuçları Tablo 1'de gösterilmiştir.

Tablo 1. Ölçeklerin Güvenirlilik ve Geçerlilik Sonuçları

| | Cronbach Alfa | CR | AVE | Animo. | Alter. | San. | Imaj | Entro | Affinity |
|----------|------------------|-------|-------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| Animo | 0.83 | 0,843 | 0,575 | 0,759 | | | | | |
| Alter | 0.85 | 0,857 | 0,667 | -0,003 | 0,817 | | | | |
| San | 0.89 | 0,896 | 0,743 | -0,022 | 0,378 | 0,862 | | | |
| Imaj | 0.89 | 0,903 | 0,629 | 0,053 | 0,363 | 0,691 | 0,793 | | |
| Entro | 0.88 | 0,851 | 0,535 | 0,258 | 0,096 | -0,249 | -0,146 | 0,731 | |
| Affinity | 0.94 | 0,943 | 0,767 | 0,092 | 0,489 | 0,657 | 0,706 | -0,124 | 0,876 |

Tablo 2'de görüldüğü gibi bulgular, ayırma geçerliliğinin de sağlandığını göstermektedir.

4.3. Ölçüm Modelinin, Aracı ve Moderatör Etkinin Değerlendirilmesi

Uyum iyiliği için önerilen modifikasyonlardan sonra ölçüm modeli kabul edilebilir değerlere ulaşmıştır (Ki-kare/sd: 1,644; RMSEA:0,043; GFI:0,86; AGFI: 0,84; NFI: 0,88; NNFI: 0,95; CFI:0,95). Marka imajının aracı etkisinin anlamsız olması tam aracı ve azalması kısmi aracı etkiyi göstermektedir. Aracı rolü Tablo 2'de gösterilmiştir.

Tablo 2. Marka İmajının Aracı Etkisinin Sonuçları

| Relationships | Direct without Mediator | Direct with Mediator | Indirect |
|----------------|-------------------------|----------------------|---------------------------|
| Animo-İmaj-Sat | -,054 (NS) | -0,42 (NS) | No mediation |
| Ethno-İmaj-Sat | -,115 (0.009) | -,106 (0.007) | No mediation |
| Affi-İmaj-Sat | ,639 (0.000) | ,391 (0.000) | Partial mediation (0,011) |

Görüldüğü gibi marka imajı düşmanlığın ve etnosentrizmin alımlara etkisinde aracı rolüne sahip değilken hayranlığın alımlara etkisinde kısmi aracılık etkisine sahiptir.

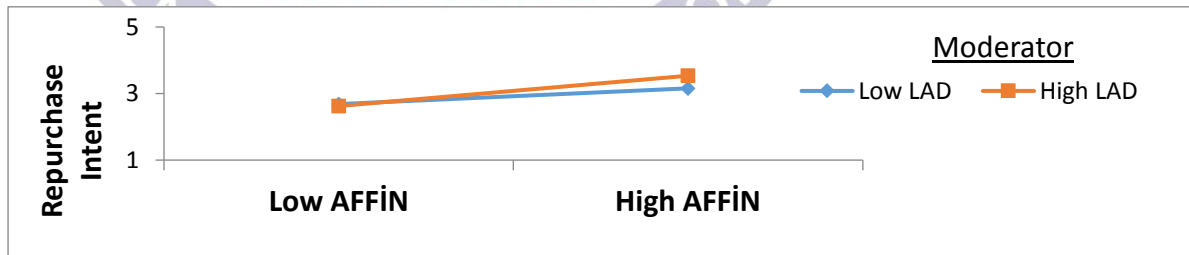
Düzenleyici etkiyi analiz etmek için düzenleyici değişken ile bağımsız değişkenin çarpılması ile elde edilen etkileşim değişkeninden yararlanılmaktadır. Bu değişken anlamlı ise, düzenleyici etkiden bahsedilebilir (Preacher ve Hayes, 2014). Bu etki Tablo 3'de gösterilmiştir.

Tablo 3. Moderatör Etki Sonuçları

| Model | Stand. Edilmemiş Beta | T.Değ. | P Değ. |
|--|-----------------------|--------|--------|
| Hayranlık | 0,495 | 5,456 | 0,000 |
| Alternatif Yok. | 0,096 | 1,768 | 0,077 |
| Etkileşim değişkeni | 0,119 | 2,946 | 0,003 |
| Bağımlı Değişken: Yabancı Menşeli Ürün Satın Alım İsteği | | | |
| Etkileşim Değişkeni: Hayranlık*Yerli Malı Alternatif Yokluğu | | | |

Görüldüğü gibi hayranlığın satın alma niyetine etkisinde yerli malı alternatif yokluğunun moderatör etki yarattığı görülmektedir. Bu etki Şekil 2'de gösterilmiştir.

Şekil 2. Moderatör Etki Analizi



Görüldüğü alternatif yokluğunun düşük olduğu durumda da yüksek olduğu durumda da hayranlığın yeniden satın alma niyetine pozitif etkisi artmaktadır.

4.4. Yapısal Modelin Değerlendirilmesi

Tablo 4’de görüldüğü gibi, yapısal model de veri ile uyum göstermiştir (Ki-kare/sd: 2.815; RMSEA:0,072; . GFI:0,95; AGFI: 0,90; NFI: 0,94; NNFI: 0,91; CFI:0,96).

Tablo 4. Araştırmadaki Etki Sonuçları

| İlişkiler | Standart Değ. | Hata Var. | T Değ. | P Deg | Hypotheses | R ² |
|-----------------------------------|---------------|-----------|--------|-------|------------|----------------|
| Affinity-Brand Image | 0.662 | 0.056 | 12.999 | 0.000 | Supported | 0.448 |
| Animosity-Brand Image | 0.016 | 0.040 | 0.371 | 0.710 | NS | |
| Ethnocentrism-Brand Image | -0.046 | 0.035 | -1.069 | 0.285 | NS | |
| Affinity-Willing to buy F.B | 0.346 | 0.091 | 5.456 | 0.000 | Supported | 0.538 |
| Animosity- Willing to buy F.B | -0.050 | 0.047 | -1.306 | 0.192 | NS | |
| Ethnocentrism- Willing to buy F.B | -0.108 | 0.041 | -2.766 | 0.006 | Supported | |
| Brand Image-Willing to buy F.B | 0.382 | 0.068 | 7.320 | 0.000 | Supported | |

Hayranlık marka imajı üzerindeki etkinin % 45’ini açıklanmaktadır. Ayrıca hayranlığın ve marka imajının satın alma niyeti üzerinde pozitif ve etnosentrizmin ise negatif yönde anlamlı etkisi bulunmaktadır. Satın alma niyeti üzerindeki etkinin % 54’ü hayranlık, etnosentrizm ve marka imajı tarafından açıklanmaktadır.

5.SONUÇ ve ÖNERİLER

Araştırma sonucunda, tüketici düşmanlığının satın alma niyeti üzerinde anlamlı bir etkiye sahip olmadığı, hayranlığın pozitif, etnosentrizmin ise negatif etkisi olduğu tespit edilmiştir. Marka imajının etnosentrizim ve düşmanlığın satın alma niyetine etkisinde anlamsız olduğu; hayranlığın satın alma niyetine etkisinde anlamlı ve kısmi aracı rolüne sahip olduğu tespit edilmiştir. Yerli malı alternatif yokluğunun hayranlık ve satın alma niyeti üzerindeki moderator etkisi anlamlı iken, düşmanlık ve etnosentrizimde anlamsız çıkmıştır.

Çalışmanın literature katkılar sunması beklenmektedir. Pazarlama literatüründe özellikle Türkiye’de daha önce yabancı ülke hayranlığı, düşmanlığı, etnik merkezilik ve alternatif yokluğunun bir arada ele alınmamasının yarattığı boşluğa katkı sağlaması beklenmektedir. Çalışmanın literatüre sağladığı katkılardan birinin de marka imajının hayranlığın alımlara etkisinde aracı rolüne sahip olduğunu ortaya koymasıdır. Çalışma sayesinde işletmeler, yabancı ülkeye hayranlığın alımlara etkisinde marka imajının etkili olduğunu farkedebilir ve güçlü marka imajına yoğunlaşmaları gerektiğini anlarlar. Çalışma bulgularının, yeni pazarlara açılmayı düşünen Türk firmalarının stratejilerini belirlemeye yardımcı olacağı düşünülmektedir. Farklı kültürlerde, demografik özelliklerde, ülkelerde ve ürün gruplarında çalışma tekrarlanabilir. Birbirine komşu olan ya da kültürel olarak yakın olan ülkelerle

karşılaştırma çalışmaları yapılabilir. Farklı değişkenlerin moderator etkisine bakılabilir. Kollektif düşmanlık ve suçluluk gibi farklı negatif duygular hayranlık ile bir arada değerlendirilebilir.

Çalışmanın sadece Türkiye'deki tüketicilere uygulanması, bilgisayar ürün grubunun, A.B.D markalarının dikkate alınması önemli kısıtlarındandır. Çalışma sonuçları farklı sektörler, ürün gruplarına, ülkelere ve tüketicilere genellenemez.

KAYNAKÇA

- Abzari, M., Ghassemi, R. A., & Vosta, L. N. (2014) "Analysing The Effect of Social Media on Brand Attitude and Purchase İntention: The Case of Iran Khodro Company", *Procedia-Social and Behavioral Sciences*, 143, 822-826.
- Amine, L.S., Chao, M.H.C.& Arnold, M.J. (2005) "Executive İnsights: Exploring The Practical Effects of Country of Origin, Animosity, And Price-Quality İssues: Two Case Studies of Taiwan and Acer in China" *Journal of International Marketing*, 13 (2), 114-150.
- Baillargeon J.C.L (2004) "Product-Country İmages in the Argentine Setting: an Analysis of Animosity and Admiration", Phd Thesis, Carleton University
- Bawa, A. (2004) "Consumer Ethnocentrism: CETSCALE Validation and Measurement of Extent", *Vikalpa*, 29(3): 43-57.
- Chan, T. S., Chan, K. K., & Leung, L. C. (2010) " How consumer ethnocentrism and animosity impair the economic recovery of emerging markets", *Journal of Global Marketing*, 23(3), 208-225.
- Fakharmanesh, S., & Miyandehi, R. G. (2013). The purchase of foreign products: The role of brand image, ethnocentrism and animosity: Iran market evidence. *Iranian Journal of Management Studies*, 6(1), 147.
- Guo, G., & Zhou, X. (2017) "Consumer ethnocentrism on product judgment and willingness to buy: A meta-analysis", *Social Behavior and Personality: An İnternational Journal*, 45(1), 163-176.
- Hair, J. F., Anderson, R. E., Tatham, R. L., & Black, W. C. (1998) " Multivariate data analysis", 5th. NY: Prentice Hall International.
- Hair, J. F., Black, W. C. & Babin, B. J. (2010) " Multivariate data analysis", 7. baskı, NJ: Prentice-Hall.
- Klein, J. G., Ettenson, R., & Morris, M. D. (1998, January) " The Animosity Model of Foreign Product Purchase: An Empirical Test in The People's Republic of China", *Journal of Marketing*, 62, 89–100.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Koubaa, Y. (2008) “ Country of Origin, Brand Image Perception, and Brand Image Structure”, *Asia Pacific Journal of Marketing and Logistics*, 20(2), 139-155.
- Low, G. S., & Lamb, C. W. J. (2000) “ The Measurement and Dimensionality of Brand Associations”, *The Journal of Product and Brand Management*, 9(6), 350–368.
- Nijssen, E. J., & Douglas, S. P. (2004). Examining the animosity model in a country with a high level of foreign trade. *International Journal of Research in Marketing*, 21(1), 23-38.
- Nijssen, E. J., Douglas, S. P., & Bressers, P. (1999) “Attitudes towards The Purchase of Foreign Products: Extending The Model. In *Academy of Marketing*”, AMA Global Marketing SIG Joint Conference.
- Oberecker, E. M., & Diamantopoulos, A. (2011) “ Consumers' Emotional Bonds with Foreign Countries: Does Consumer Affinity Affect Behavioral Intentions?”, *Journal of International Marketing*, 19(2), 45-72.
- Preacher, K. J., & Hayes, A. F. (2004) “ SPSS and SAS Procedures for Estimating Indirect Effects in Simple Mediation Models” *Behavior research methods*, 36(4), 717-731.
- Rose Mei, Rose Gregory M., Shoham Aviv. (2009) “The Impact of Consumer Animosity on Attitudes Towards Foreign Goods: A Study of Jewish and Arab Israelis,” *Journal of Consumer Marketing*, 26/5, 330–339.
- Shimp, T.A., & Sharma, S. (1987) “Consumer Ethnocentrism: Construction and Validation of the CETSCALE”, *Journal of Marketing Research*, 24(3), 280-289.
- Sutikno, B., & Ming-Sung Cheng, J. (2011) “Towards Consumer Ethnocentrism and Animosity in Indonesia”, *International Journal of Management and Business Research*, 1(1), 15-18.
- Wongtada, N., Rice, G., & Bandyopadhyay, S. K. (2012) “ Developing and Validating Affinity: A new Scale to Measure Consumer Affinity toward Foreign Countries”, *Journal of International Consumer Marketing*, 24(3), 147-167.

**ÜNİVERSİTE ÖĞRENCİLERİNİN ÜRÜN VE MARKALARA YÖNELİK İNSAN
BİÇİMSELLEŞTİRME ALGILARI: BİR FENOMENOLOJİK ARAŞTIRMA**

Doç. Dr. Hatice AYDIN*

Prof. Dr. Sevtap ÜNAL**

ÖZET

İnsan biçimselleştirme, bir takım insani özelliklerin nesnelere aktarılmasıdır. Bu araştırmanın amacı, üniversite öğrencilerinin antropomorfik algısını ve satın alma davranışına nasıl yansıdığını ürün grupları açısından anlamaya çalışmaktır. Fenomenoloji deseninde gerçekleştirilen bu araştırmaya Bandırma Onyedi Eylül Üniversitesinde eğitim alan 18 öğrenci kolay durum örnekleme ile katılmıştır. Araştırma verileri öğrencilerle odak grup görüşmeleriyle toplanmıştır. Görüşme verileri betimsel analiz ile analiz edilmiştir. Araştırma sonucunda dayanıklı ürün grubunda Arçelik markasında ve dayanıksız ürün grubunda ise Etipuf ve Yumoş markasında insani özelliklerden yararlanmanın daha etkili olduğu tespit edilmiştir. Dayanıklı ürün gruplarında antroporfik özelliklerin satın alma yönünde istek uyandırmadığı söylenebilir. Ancak dayanıksız ürün gruplarında özellikle "Yumoş" markalı temizlik ürünlerinde ve "Etipuf" markalı gıda ürünlerinde satın alma yönünde etkili olabileceği öne sürülmüştür.

Anahtar Kelimeler: Antropomorfizm, Dayanıklı Ürünler, Dayanıksız Ürünler

Jel Kodları: M21, M30, M31

**PERCEPTIONS OF ANTHROPOMORPHISM OF PRODUCTS AND BRANDS BY
UNIVERSITY STUDENTS: A PHENOMENOLOGICAL RESEARCH**

ABSTRACT

Anthropomorphism is the transfer of some human characteristics to objects. The aim of this research is to understand the anthropomorphic perception of university students and how they are reflected in purchasing behavior in terms of product groups. 18 students who were educated in Bandırma Onyedi Eylül University participated in this study which was carried out in Phenomenology Pattern with easy case sampling. The research data were collected by focus group interviews with the students. Interview data were analyzed with descriptive analysis. At the end of the research, it can be said that using human characteristics are more effective in terms of "Etipuf" and "Yumoş" which are

* Bandırma Onyedi Eylül Üniversitesi, Ömer Seyfettin Uygulamalı Bilimler Fakültesi, Balıkesir, Türkiye email: haydin@bandirma.edu.tr.

** İzmir Katip Çelebi Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İzmir, Türkiye email: sevtap.unal@ikc.edu.tr.

nondurable brands and "Arçelik" which is a durable brand. It can be said that antropomorphic feautres in durable product groups do not awaken the purchase intention. However, it has been suggested that anthropomophic features can be effective on purchase intention in terms of nondurable product as Yumuş which is branded as cleaning products and Etipuf which is branded as food products.

Keywords: *Anthropomorphism, Durable Products, Nondurable Products*

Jel Codes: *M21, M30, M31*

1.GİRİŞ

İnsan biçimselleştirme, nesnelere insana özgü nitelikler yakıştırma eğilimi olup eskiden beridir yaygın olan bir kavramdır. Nesneye insan özelliklerinin verilme nedeni, insanın kusursuz bir varlık olarak görülmesidir (Altınel, 2003: 109). İnsan biçimselleştirme, nesnelere niteliklerinin ötesinde anlam kazandırmaya çalışmaktır (Altınel, 2003: 110). Ürün ya da marka yardımsever, kibar gibi insanın sahip olabileceği her türlü özelliklerle sunulabilmektedir. Böylece, marka konumlandırması sağlanabilmektedir (Pringle ve Thompson, 2000: 56-57). Temizlik ürünleri gibi dayanıksız ürünlerde insan biçimselleştirmeden yararlanılabileceği gibi dayanıklı ürünlerde de yararlanılabilmektedir. Dolayısıyla rasyonel ve hedonik fayda elde etme beklentisi ile alınan her iki ürün grubunda insan biçimselleştirmenin yaygın şekilde kullanıldığı söylenebilir. Bazı ürün gruplarında markalara insani özellikler kazandırılması bazı duyguları da uyatabilmektedir (Altınel, 2003: 108). İnsan biçimsellik, tüketicinin markaya karşı pozitif hisler (Rauschnabel ve Ahuvia, 2014) ve negatif hisler taşımaya yol açabilmektedir (Bernhard, 2015).

Bu çalışmada ürün ve markalarda insan biçimselleştirmenin nasıl algılandığını ortaya çıkarabilmek amaçlanmıştır. Ayrıca ürün grupları açısından, rasyonel fayda sağlayan dayanıklı ürünlerde ve hedonik fayda sağlayan dayanıksız ürünlerde bu olduğunun satın almaya nasıl teşvik ettiğini ortaya koyabilmek de amaçlanmıştır. Araştırmada teorik bilgiler ve analiz bulguları verilerek çalışmanın literatüre katkıları sağlanması beklenmektedir.

2.LİTERATÜR TARAMASI

İnsan biçimselleştirmenin pazarlama literatüründe ele alındığına dair çalışmalara çok fazla rastlanmamıştır. Yapılan alıřmalardan bazılarında insan biçimselliğın sadece duygulara etki ettiğine dairdir (Hunting, 2013; Pfeifer, Groeppel-Klein ve Helfgen, 2013; Rauschnabel ve Ahuvia, 2014; Bernhard, 2015; Stresewski, 2016). Bu kavram geçmişten beridir günümüze kadar bazı çalışmalarda daha açık ifade edilmekte ve etkisini hissettirmektedir. Bu anlamda, Ahuvia (1993) insanlara benzeyen şeylerin, insana benzemeyen şeylerden gerçekten daha çok sevildiğini ifade etmektedir. Rauschnabel ve

Ahuvia (2014) ise antropomorfizmin marka sevgisini artırma konusunda güçlü bir kabiliyete sahip olabileceğini gösteriyor. Kavram geçmişten beridir literatüre konu olsa da ürün grupları açısından nasıl algılandığı ve satın alma davranışına nasıl yansıtacağına dair gözleme dayalı bir çalışmaya rastlanmamıştır.

3.YÖNTEM

Araştırma deseni olarak fenomenolojik desenden yararlanılmıştır. Fenomenolojik desen, bireylerin bir olguya ilişkin deneyimleri nasıl anlamlandırdıkları ortaya çıkarılmaya çalışılır (Creswell, 2007). Bu desende araştırmaların amacı, bir olguya dair anlamları keşfetmek ve deneyimlenmiş dünyayı tanımlamaktır. Fenomenolojide, bireylerin algılarının çevresel koşullardan etkilendiği de dile getirilmektedir (Lopez ve Willis, 2004). Bu araştırma, öğrencilerin antropomorfizm algısını ürün grupları açısından ortaya çıkarmayı amaçladığı için nitel araştırma desenlerinden fenomenoloji desende gerçekleştirilmiştir. Böylece, hangi ürün gruplarında tüketicilerin bu olguyu daha çok aldıkları ve bu olgunun satın alma davranışına nasıl yansıdığı fenomenolojik açıdan değerlendirilmeye çalışılmaktadır.

Görüşmeler, Bandırma Onyediy Eylül Üniversitesinde eğitim alan öğrencilerle gerçekleştirilmiştir. Öğrencilerin seçilmesinde amaçlı örneklem türlerinden kolay ulaşılabilir durum örnekleme dikkate alınmıştır. Kolay ulaşılabilir durum örneklemesinde araştırmacı erişilmesi kolay olan bir örnekleme seçmekte ve örnekleme kolay ulaşmak istemektedir (Yıldırım ve Şimşek, 2013: 141; Boylu ve Çal, 2018: 72). Araştırmaya katılan öğrencilerin demografik özellikleri Tablo 1’de verilmiştir.

Tablo 1. Demografik Özellikler

| Yaş | Median | Mod | Ailenin Gelir Düzeyi | f | % |
|---------------|-----------|------------|----------------------|-----------|------------|
| Median | 21.50 | 22.05 | 1700 TL altı | 9 | 0.50 |
| Cinsiyet | f | % | 1700-5000 | 6 | 0.33 |
| Kadın | 10 | 0.56 | 5000 tl üzeri | 3 | 0.17 |
| Erkek | 8 | 0.44 | | | |
| Toplam | 18 | 100 | | 18 | 100 |

Tablo 1’de görüldüğü gibi katılımcıların yaş ortalaması 21,5 olup çoğunluğunun 1700 TL altı (%50) gelire sahip kadın (%56) tüketiciler olduğu belirlenmiştir.

4.VERİLERİN TOPLANMASI VE ANALİZİ

Yarı-yapılandırılmış görüşmelerde, görüşme amacına göre belli bir sırayla sorulmak üzere bir dizi soru hazırlanır. Bu çalışmada da verilerin toplanması 6 kişilik üç odak grup görüşmesi ile gerçekleştirilmiştir. Katılımcıların yarı yapılandırılmış görüşmeler kapsamında aşağıdaki üç soruyu ürün gruplarını düşünerek cevaplandırmaları istenmiştir. Hazırlanan sorular katılımcılara aynı şekilde sorulur ve katılımcılar soruları istedikleri şekilde yanıtlayabilirler. Bu bağlamda sorular, ilgili ürünlerin reklamlarda geçen antropomorfik resimleri ile birlikte sorulmuştur.

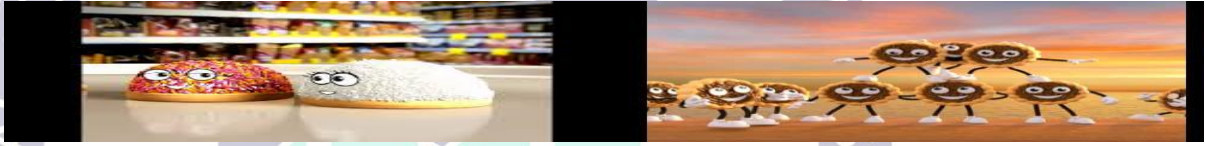
Soru 1. Aşağıda gördüğümüz ürünlerden hangisi daha çok insana benzetilmektedir ve sizde hangi duyguyu uyandırmaktadır?

Dayanaksız Ürün Grubu

Gıda ürünü

Etipuf ()

Eticin ()



() Sevgi () Bağlılık () Aşk () Nefret () Diğer.....(Belirtiniz.)

Temizlik Ürünü

Cif ()

Rinso ()

Yumoş ()



() Sevgi () Bağlılık () Aşk () Nefret () Diğer.....(Belirtiniz.)

Dayanıklı Ürün Grubu

Beyaz Eşya

Vestel ()

Arçelik ()



() Sevgi () Bağlılık () Aşk () Nefret () Diğer.....(Belirtiniz.)

Soru 2. Seçtiğiniz ürün ve markalarında kullanılan insanlaştırma özelliği satın alma davranışınızda etkili midir?

Soru 3. Söz konusu ürün ve markaları dışında insani özellikleri ile karşınıza çıkan ya da hatırladığınız bir ürün grubu ve markası söyleyebilir misiniz?

Analiz yöntemi olarak betimsel analizden yararlanılmıştır. Betimsel analizde, görüşülen bireylerin görüşlerini daha net yansıtmak için doğrudan alıntılara yer verilmektedir (Yıldırım ve Şimşek, 2013). Alıntılar bulgular kısmında yer almıştır.

5.BULGULAR

Görüşmeler kapsamında her soruya verilen cevaplar aşağıdaki gibi ayrı ayrı gösterilmiştir.

Gördüğünüz ürünlerden hangisi daha çok insana benzetilmektedir ve sizde hangi duyguyu uyandırmaktadır?, sorusuna verilen cevaplar aşağıdaki gibidir:

“Arçelik markası daha çok insana benzetilmiştir. Beyaz eşya markası olduğu için bu tarz ürünlerin reklamlarında çelik karakteri ile dayanıklılığa vurgu yapılmaktadır. Dayanıklı ve güçlü bir insanı hatırlatıyor” (**Koray**). “Yumoş, daha çok insana benzetilmiştir. Ferahlık duygusunu uyandırmaktadır” (**Selda**). “Deterjan gibi temizlik ürünlerinde daha çok benzetilmektedir. Ferahlık duygusu veririr. Yumoş” (**Volkan**). “Etipuf, sevimli ve tatlı insana benziyor. Ancak Rinso ise itici ve ürkütücü bir insana benzetilmiştir (**Bade**). “Eticin, hep birlikte el ele dans etmeleri bende birlikteliği uyandırıyor” (**Yağmur**). “Rinso, hoş ve berrak duygular uyandırıyor” (**Aynur**). “Vestel, kendi ürettiği ürünün robotunu yaparak insanı heyecandan çeki kullanmaya itmektedir.” (**Murat**). “Arçelik, bende herhangi bir duygu uyandırmasa da şekil olarak insana daha çok benzemektedir.” (**Halil**). “Arçelik, insani özellikleri var. Çelik naz karakterleri var. Onların insani özellikleri var. Aşk ve sevgi gibi. Birbirlerine aşıklar ve insani özellikler taşıyorlar. (**Bilal**). “ Vestel, kendi ürettiği ürünün robotunu yaparak insanı heyecandan çekip kullanmaya itmektedir.” (**Yunus**). “Etipuf, komiklik duygusunu hissettiriyor” (**Sibel**). “Arçelik, dayanıklılık ve kaliteli algısını uyandırarak beğenme yönünde bende olumlu his uyandırmaktadır.” (**Aytaç**). “Etipuf daha çok insanın zevklerini ön plana çıkarmaktadır” (**Elif**). “Yumoş, temizlik ve saflık duygusu ile insani özellikleri ön plana çıkarmaktadır” (**Yağmur**). “Eticin ve Arçelik iki farklı ürün olarak insana daha çok benzemektedir. Özellikle Arçeliğin bayan versiyonu daha çok duygusallığı ön plana çıkarmıştır. Onu görünce insan kendisini daha çok mutlu hissetmektedir. Eti cinde ise eğlence, komiklik ve neşe duygusu ön plana çıkmaktadır. Eticini yersem daha neşeli olurum sanıyorum. (**Aykut**). “ Yumoş bir yandan Arçelik de diğer yandan insana daha çok benzetilmektedir. Yumoş daha çok pufidik, sevimli ve sıcak duyguları uyandırmaktadır. Rinsonun mutluluk mesajı ve arçeliğin güven, dayanıklılık ve güç duyguları ön plana çıkmaktadır.” (**Merve**).

“Yumoş ve Arçelik ikisi de insani özellikleri yansıtmaktadır. Yumoş ferahlık, yumuşaklık ve temizlik, Arçelik ise aile bağlarını yansıtmaktadır. Arçelikte iki kişi hayat kuruyor ve hayatlarında o makinalar da hayatı kolaylaştırmaktadır.” **(Rukiye)**. “ Arçelikte sevgi var. Aile yakınlığı var. Bu daha sempattir. Aile duygusunu ön plana çıkarıyor” **(Burak)**.

Seçtiğiniz ürün ve markalarında kullanılan insanlaştırma özelliği satın alma davranışınızda etkili midir?

“Satın alma amacı ile firmalar sonuçta bu özelliği kullanır”. Ama benim satın alma davranışımı etkilemiyor” **(Koray)**. “Satın alma davranışında kesinlikle etkili değildir” **(Selda)**. “Satın almam genelde ama deterjan gibi ürünleri alırım belki ihtiyaç duyduğum ürün grubu olduğu için” **(Volkan)**. “Abur-cubur ürünlerinde satın alma davranışında çok etkili bir güç oluşturmaktadır” **(Bade)**. “Eticinin özellikle çocukların satın alma davranışlarında etki uyandırdığını düşünüyorum. **(Yağmur)**. “Bayan olduğum için benim alımlarımı etkilemez. Alırken daha çok cezbeden şeylere bakarım” **(Aynur)**. “Alımlarımı etkilemez, alımlarımda rasyonel kararlar daha etkilidir. Mesela fiyatlara bakarım ve karşılaştırma yaparım.” **(Murat)**. “Bu özellik satın alma davranışlarımı kesinlikle etkilemez. Anlık zevklerim var sonuçta... onlara göre alım yaparım” **(Halil)**. “Her üründe etkilemez. Ama yumuş gibi ürünlerde yumuşaklık hissi ben de alma yönünde bir etki yaratır.” **(Bilal)**. “Satın alma davranışımı etkilemez” **(Yunus)**. “Bu duygu ürünün kalitesi hakkında akılda kalıcılığı artırır ama alımlarımı etkilememektedir. **(Sibel)**. “Satın alma durumumu yüzde eli yüzde elli etkilemektedir. Amaç dikkat çekmek ve duyguları etkilemektir. Mesela kırmızı bir çamaşır makinası aşk duygusunu uyandırmaktadır” **(Aytaç)**. “Dayanaksız ürünlerde gıdada etipuf, temizlik ürünlerinde is yumuş satın alma davranışımı etkilemektedir” **(Elif)**. “Çikolata gibi gıda ürünlerinde daha çok almaya teşvik etmektedir.” **(Yağmur)**. “Arçelikte alımlarımı etkilemez. Ama Etipufun enerjisi alma isteğimi harekete geçirir. Bende hazcı duygularımı harekete geçirdiği için alımlarım artar.” **(Aykut)**. “Arçelik bende alma yönünde hareket uyandırmaz. Çünkü uzun vadeli olan ürünlerde daha çok rasyonel ve gerçekçi şeyler ararım. Ama Yumoş reklamlarında verilmeye çalışılan mutluluk mesajları alımlarımı etkiler ve verdiği olumlu hislerle alım yaparım.” **(Merve)**. “Uzun vadede ürün olan Arçelikte alımlarımı etkilemez. Dayanıklılık ararım. Ama yumuş markası gibi ürünlerde hedonik alım yaptığım için insani özelliklerden etkilenerek alabilirim” **(Rukiye)**. “ İnsani özellikler benim duygularımı etkiler. Ama hiçbir ürün de benim almamı sağlamaz” **(Burak)**.

Söz konusu ürün ve markaları dışında insani özellikleri ile karşınıza çıkan ya da hatırladığınız bir ürün grubu ve markası söyleyebilir misiniz?

“Labne Konuşan Beyin” (**Koray**). “Sütaş İnekleri” (**Selda**). “Sütaş” (**Volkan**). “Sütaş” (**Bade**). “Sütaş” (**Yağmur**). “Labne konuşan beyin” (**Aynur**). “Labne konuşan beyin” (**Murat**). “Labne konuşan beyin” (**Halil**). “Michell Lastikleri” (**Bilal**). “Ozmo konuşan lastik” (**Yunus**). “Mr. Muscle” (**Sibel**). “Can bebe Çikolata” (**Aytaç**). “Familia Ponpongiller” (**Elif**). “Can Bebe” (**Yağmur**). “Prima” (**Aykut**). “Türk Telekom” (**Merve**). “Bruno Sprey” (**Rukiye**). “Michell Lastik” (**Burak**).

6.SONUÇ VE ÖNERİLER

Üniversite öğrencilerinin antropomorfizm algısını ve satın alma davranışına nasıl yansıdığını ürün grupları açısından ortaya koymaya çalışan ve fenomenolojik deseninde gerçekleştirilen bu çalışmada şu sonuçlar elde edilmiştir:

Antropomorfizm algısı ürün grupları açısından değerlendirildiğinde, dayanıklı ürün grubunda “Arçelik” markasında ve dayanıksız ürün grubunda ise gıda ürününde “Etipuf” ve temizlik ürününde “Yumoş” markasında insani özelliklerin tüketici algısına olumlu etkilerinin olduğu belirlenmiştir. Dolayısıyla insan biçimsellik söz konusu olunca ilk ve en çok bu markaların hatırlandığı söylenebilir. Katılımcılara göre Arçelik, çelik figürü ile dayanıklılık, güç, aile bağları ve bağlılığa vurgu yapmaktadır. Arçelik reklamları da bu durumu doğrulamaktadır. Söz konusu markanın reklamlarında iki kişi birliktelik kurmakta ve makinalar da bu birlikteliği kolaylaştırmaktadır. Arçelik markasının insani özelliklere yer vermesinin farkındalık ve tüketici zihnine ulaşma konusunda oldukça başarılı olduğu söylenebilir. Yumoş markası daha çok temizlik ve saflık duygusunu uyandırırken Etipuf markası sevimlilik, komiklik ve tatlılık özelliklerini yansıtmaktadır.

Katılımcılar dayanıklı tüketim mallarında maskotun alımları yönlendirmeyeceğini, kolayda ve eğlencelik ürünlerde etkili olduğunu ifade etmişlerdir. Özellikle “Yumoş” markalı temizlik ürünlerinde insan biçimselliğin satın alma isteği uyandırdığı belirlenmiştir. Dayanıklı ürünlerin yüksek fiyatlı ve sık satın alınmayan ürün grubunda yer alması insani özelliklerin satın alma davranışına etki etmemesinde bir neden olabilir. Ancak şurası da bilinen bir gerçektir ki tüketiciler alımlarını açık güdülerini ifade etseler de tüketici davranışında gizli güdülerin rolü oldukça fazladır. Dayanıklı ürünlerde tüketicilerin rasyonel fayda beklentileri baskın olmakla birlikte gizli güdülerini sözlü olarak ifade etmeyeceklerini kabul etmek gerekir. Dolayısıyla elde edilen sonuçtan yola çıkarak dayanıklı ürünlerde insan biçimcilik uygulamalarının satın alma davranışında etkili olmadığını ileri süremeyiz. Sadece katılımcılar satın alım kararlarında insan biçimli maskotların yönlendirici olmadığını ifade etmişlerdir. İnsani özellikleri yansıtan diğer markalar olarak en çok “Labne” ve “Michell Lastik”, bilinmektedir. Söz konusu markalar kişiselleştirilen maskotların daha fazla akılda kaldığını desteklemektedir.

Pazarlama literatüründe insan biçimselliğin ürün grupları açısından tüketiciler tarafından nasıl algılandığını ve satın alma davranışına nasıl etki ettiğini ortaya koyan nitel araştırmalara çok fazla rastlanılmamıştır. Çalışmanın bu anlamda literatürdeki boşluğa katkı sunması beklenmektedir.

Çalışma sonuçları itibari ile işletmelere de fikir verebilmektedir. İşletmeler satışlarını arttırmak ve satın alma davranışını etkilemek için özellikle dayanıksız ürün gruplarında insani özellikleri ön plana çıkaran reklamlardan daha çok yararlanabilecekleri söylenebilir. Çünkü dayanıksız ürün grubu olarak hem “Yumoş” hem de “Etipuf” markasında insan biçimselleştirme etkisinin daha çok hissedildiği ifade edilmiştir. Ancak dayanıklı ürün gruplarında rasyonel özelliklerin de dikkate alınarak konumlama stratejilerinden yararlanılmalıdır.

Çalışma, ilerde yapılacak çalışmalar için de çeşitli fikirler verebilmektedir. İlerde yapılacak çalışmalarda üniversite öğrencileri dışında daha farklı örnekleme gidilebilir. Daha ileri nitel çalışmalar ile insan biçimselleştirmede etkisi olduğu düşünülen temalar ortaya çıkarılabilir ve bu anlamda içerik analizinden yararlanılabilir. Çalışmada kolay durum örneklemesinden yararlanılması en önemli kısıtlarından biri olarak görülmektedir. Diğer bir kısıt beyaz eşya alımlarında çok etkin bir role sahip olmadığı düşünülen gençlerin örnekleme dâhil edilmesidir.

KAYNAKÇA

- Ahuvia, A. C. (1993) “I Love It! Towards a Unifying Theory of Love across Diverse Love Objects”, Doctoral Dssertation, University of Michigan, United States.
- Altınel, H. Y. (2003) “Reklamlarda İnsanbiçimsellik”, İletişim Araştırmaları, 1(1): 107-121.
- Bernhard, I. (2015) “Haters Gonna Hate: The Influence of Avoidance Type, Company Characteristics and Anthropomorphism on Brand Hate”, Master's Thesis, University of Twente, Netherlands.
- Boylu, E. ve Çal, P. (2018) “Suriyeli Mültecilerin Türkçe Kursuna Başlamadan Önceki Söz Varlığı Durumları”, Ana Dili Eğitimi Dergisi, 6(1), 68-94.
- Creswell, J.W. (2007) “Qualitative Inquiry & Research Design Choosing Among Five Approaches”, London: Sage.
- Hunting, J. (2013) “On a Brand Love Quest”, Master Thesis. University of Twente, Netherlands.
- Lopez, K. A.ve Willis, D. G. (2004) “Descriptive Versus Interpretive Phenomenology: Their Contributions to Nursing Knowledge”, Qualitative Health Research, 14(5): 726-735.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

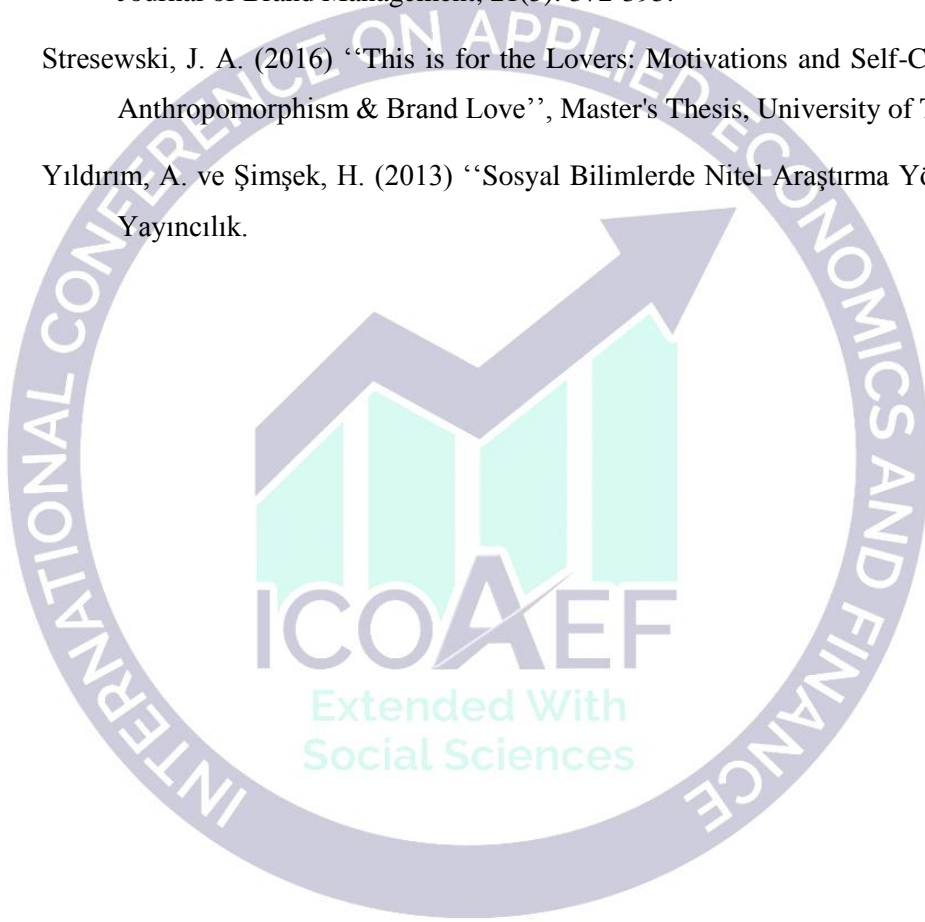
Pfeifer, K., Groeppel-Klein, A. ve Helfgen, J. (2013) “Humanized Products in TV Ads: How Anthropomorphism Can Elicit Emotions, Enhance Attitudes, and Affect Purchase Likelihood”, *ACR European Advances*, 10: 365-366.

Pringle, H. ve Thompson, M. (2000) “Marka Ruhü-Sosyal Sorumluluk Kampanyaları ile Marka Yaratmak”, Çev: Zeynep Yelçe ve Canan Feyyat, İstanbul: Scala Yayıncılık.

Rauschnabel, P. A. ve Ahuvia, A. C. (2014) “You’re So Lovable: Anthropomorphism and Brand Love”, *Journal of Brand Management*, 21(5): 372-395.

Streowski, J. A. (2016) “This is for the Lovers: Motivations and Self-Congruity as Antecedents of Anthropomorphism & Brand Love”, Master's Thesis, University of Twente, Netherlands.

Yıldırım, A. ve Şimşek, H. (2013) “Sosyal Bilimlerde Nitel Araştırma Yöntemleri”, Ankara: Seçkin Yayıncılık.



**MAKRO AÇIDAN ÇEVRESEL POLİTİKALARIN ATIK YARATMA ÜZERİNDEKİ
ETKİSİNİN PANEL VERİ ANALİZİ İLE ÖLÇÜLMESİ: SEÇİLMİŞ OECD ÜLKELERİ
ÜZERİNE BİR ANALİZ**

Dr. Öğr. Üyesi Hüseyin ÖNDER*

ÖZET

Çevre kirliliği tüm canlıların yaşamını tehdit eden en önemli sorunlardan birisidir. İnsanoğlu ekonomik ve sosyal faaliyetleri ile bir taraftan kirliliğe neden olurken diğer taraftan bu kirliliği azaltmak için ekonomik ve idari tedbirler almaktadır. OECD, üye ülkelerin çevre kirliliğini azaltmakta uyguladığı politikaların katılığını ölçmek için bir endeks oluşturmuştur. Bu endeks ülkelerin vergi, tarife, ticaret şemaları ve teşviklerle ilgili politikalarını puanlamaktadır. Bu çalışmada söz konusu endeks ile ölçülen çevresel politikaların, atık yaratma üzerindeki etkisi Panel Veri Analizi ile ölçülmüştür. Araştırmada 26 OECD ülkesinin 2007-2012 yılları arasındaki verileri kullanılmıştır. Modelde çevresel politika katılığı değişkeninin yanında kentleşme, sanayileşme ve GSYH değişkenleri de yer almıştır. Driscoll Kraay Tahmincisi ile gerçekleştirilen analiz sonuçlarına göre; çevresel politika katılığının atık yaratma üzerinde istatistiki açıdan anlamlı bir etkisinin olmadığı, sanayileşmenin atık oluşumunu arttırdığı ve kentleşme oranının ise atık oluşumunu azalttığı sonucuna ulaşılmıştır. Dolayısı ile ülkelerin uyguladıkları çevresel politikaları gözden geçirmesi ve daha etkin politika araçlarını uygulaması gerekmektedir.

Anahtar Kelimeler: Makro İktisat, Çevre Politikası, Atık, Panel Veri, OECD

JEL Kodları: E00, H23, O13.

* Dumlupınar Üniversitesi, İ.İ.B.F. İktisat Bölümü, Merkez Kampüs, Kütahya/Merkez, Türkiye, huseyin.onder@dpu.edu.tr.

**THE MEASUREMENT OF THE EFFECT OF ENVIRONMENTAL POLICIES ON THE
WASTE CREATION FROM THE ASPECT OF MACRO: AN ANALYSIS ON THE
SELECTED OECD COUNTRIES**

ABSTRACT

Environmental pollution is one of the most important problems that threaten the lives of all living things. While the human being causes pollution with its economic and social activities on the other hand, he takes economical and administrative precautions to reduce this pollution. The OECD has composed an index to measure the rigidity of policies implemented by member states to reduce environmental pollution. This index scores countries' tax, tariff, trade schemes and policies on incentives. At this study, the impact of the environmental policies on waste generation is measured by Panel Data Analysis. At the research, yearly data of 26 OECD countries is used for the period of 2007-2012. In addition to the environmental policy rigidity variable, urbanization, industrialization and GDP variables are also rank in the model. According to the findings of Driscoll Kraay Estimator; environmental policy rigidity does not have a statistically significant effect on waste generation, industrialization increases waste generation, and urbanization rate decreases waste generation. Therefore, countries have to review their environmental policies and implement more effective policy instruments.

Keywords: *Macro Economy, Environmental Policy, Waste, Panel Data, OECD*

JEL Codes: *E00, H23, O13*

1. GİRİŞ

Hem gelişmiş hem de gelişmekte olan ülkelerde gerçekleşen hızlı sanayileşme, giderek azalan ve yok olma tehlikesi bulunan doğal kaynaklar ve bunların dışında katlanarak artan nüfus çevresel endişelerin oluşmasına neden olmuştur. Günümüzde çevre sorunu sadece ülkelerin değil tüm insanlığın ortak sorunu olmuştur. Çünkü insanoğlunun kullandığı üretim, yöntem ve mekanizmaları karşısında, doğanın kendini koruması, yinelemesi oldukça güçleşmiş ve bazı yerlerde ise tamamen geri dönülmez bir sürece girilmiştir. Tüm bunların sonucunda da mevsimler değişmekte, buzullar erimekte, ormanlar acımasızca katledilmekte, denizler kirletilmekte, soluduğumuz hava zehirle yüklenmekte, kulaklarımız, gözlerimiz ve beynimiz; gürültü, beton ve metal kirliliği ile doldurulmaktadır (Baykal ve Baykal, 2008:3).

Türk mevzuatında çevre kirliliği, 2872 sayılı Çevre Kanunu'nda "İnsanların her türlü faaliyetleri sonucu, havada, suda ve toprakta meydana gelen olumsuz gelişmelerle ekolojik dengenin bozulması ve aynı faaliyetler sonucu ortaya çıkan koku, gürültü ve atıkların çevrede meydana getirdiği arzu edilmeyen sonuçlar" olarak tanımlanmıştır. Canlıların yaşamlarını sürdürebilmesi için ihtiyaç duydukları hava, toprak ve suda meydana gelen kirlilik, canlı yaşamını tehdit etmektedir. Belli bir seviyenin üzerinde gerçekleşen hava kirliliği, hastalıklara ve hatta ölümlere neden olurken, su kirliliği ise balıkların ve diğer su canlılarının ölmesine neden olmaktadır. Son olarak toprak kirliliği de ekilebilir tarım alanlarının yok olmasına neden olmaktadır (İraz, 2018:4).

Çevre sorunları doğal afetler, yanardağlar, şiddetli yağmur ve seller vb. olaylar sonucu ortaya çıkabilmektedir. Ama çoğunlukla çevre sorunları insan kaynaklıdır. Tüm dünya ülkeleri çevre sorunlarının varlığını ve etkilerini kabul etmektedir. Dolayısıyla çevre sorunları bölgesel olmaktan çıkarak küresel bir sorun haline dönüşmüştür (Kaypak, 2014:19).

Çevre kirliliğinin en temel faktörlerinden biri insanoğlunun ekonomik ve sosyal faaliyetleri sonucunda çevreye bırakmış olduğu atıklardır. İnsanoğlu bu sorunu aşmak için bir taraftan üretim, diğer taraftan tüketim süreçlerini değiştirmeye çalışmaktadır. Bu amaçla doğrusal üretim olarak adlandırılan ve al-yap-at olarak tanımlanan süreci, döngüsel ekonomi modeline çevirmeye çalışırken, diğer taraftan tüketicilerin yenilenebilir ve atık oluşumu az ürünleri tercih etmesi teşvik edilmektedir. Buradaki temel unsur ortaya çıkabilecek atık miktarını en aza indirmektir. Ayrıca atıkları toplama, sınıflandırma ve bertaraf etmek için teknolojik ve organizasyonel yenilikler hayata geçirilmektedir. Bütün bu çabalar makro açıdan kamu otoritesinin uyguladığı çevresel politikalar ile desteklenmektedir.

Bu çalışmada OECD ülkelerin makro açıdan uygulamış olduğu çevresel politikaların atık yaratma üzerindeki etkileri analiz edilecektir. Böylelikle kamu gücünün uygulamış olduğu çevresel politikaların etkisi analiz edilecektir. Bu amaçla OECD'nin yayınlamış olduğu Çevresel Politika Katılık Endeksi (Environmental Policy Stringency Index) kullanılacaktır.

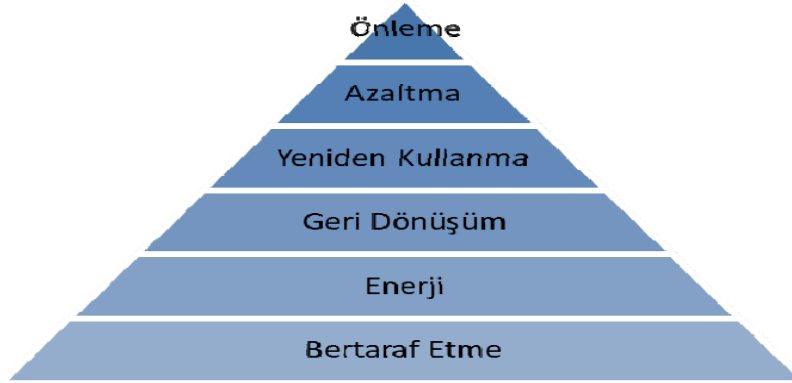
2. ATIK SORUNU VE ATIK YÖNETİMİ

Son yıllarda çevre sorunları içerisinde en önemlisi sorun atık sorunudur. Atık, ömrünü tamamlamış dolayısıyla kullanılmayan ürünlerin imalat, ticaret, üretimden sonra yok etme gibi diğer yan ürünleri olarak tanımlanmaktadır. Atık, ürünlerin yaşam döngüsü boyunca işlenmesi ve taşınmasında kullanılan materyallerin bir bölümüdür. Bir örnekle açıklamak gerekirse yaşam döngüsü boyunca, 10 gramlık bir altın yüzük, yaklaşık olarak 3 ton atık oluşturur (Görmüş, 2018:54). Dolayısı ile hacim olarak küçük gibi gözükken ürünlerin üretiminde bile kendilerine kıyasla oldukça yüksek bir atık ortaya çıkabilmektedir.

Atıkla ilgili farklı tanımlamalar yapılabilmektedir. Örneğin Türk mevzuatında atık ilk olarak 1983 tarihli ve 2872 sayılı Çevre Kanunu'nda "Herhangi bir faaliyet sonucunda çevreye atılan veya bırakılan zararlı maddeler" şeklinde tanımlanmıştır (Gündüzalp ve Güven, 2016:2).

Atıkların, çevreye ve insan sağlığına zarar vermeden toplanması, taşınması, geri kazanılması, zararsız hale getirilmesi veya düzenli bir şekilde bertaraf edilmesi gerekmektedir (Görmüş, 2018:55). Atık yönetimi olarak ifade edilen bu süreç ile atıkların en aza indirilmesi amaçlanmaktadır. Atık oluşumunun ve zararlarının azaltılmadığı durumlarda ise atık malzemelerin yeniden kullanılması, geri dönüştürülmesi, geri kazanılması ya da bir enerji kaynağı olarak kullanılması amaçlanır. Ancak bunlardan herhangi birinin mümkün olmadığı durumlarda atıkların güvenli bir şekilde bertaraf edilmesi sağlanmalıdır. Bu süreç "Atık Yönetimi Amaç Hiyerarşisi" olarak adlandırılmaktadır. Aşağıda Şekil 1'de gösterilen Atık Yönetimi Amaç Hiyerarşisinde en önemli kısım piramidin en üstünde yer alan atık önleme aşamasıdır. Çünkü atık oluşumu önlenirse atıkların toplanmasına, sınıflandırılmasına ve depolanmasına gerek kalmayacaktır. Dolayısıyla hem bu süreçlerde ortaya çıkabilecek maliyetler hem de atıkların çevreye ve insan sağlığına olan negatif etkileri önlenmiş olacaktır. Ayrıca depolama ve atık bertarafı için kullanılacak olan kıt arazi kaynakları da başka amaçlar için kullanılabilir (Önder, 2018:35). Atıkların giderek değerlenen arazileri işgal etmesinin yanında su, hava ve toprak kaynağını da kirleterek farklı çevresel sorunlar ortaya koyduğu ifade edilebilir (Büyükbektaş ve Varınca, 2008: 2).

Şekil 1. Atık Yönetimi Amaç Hiyerarşisi

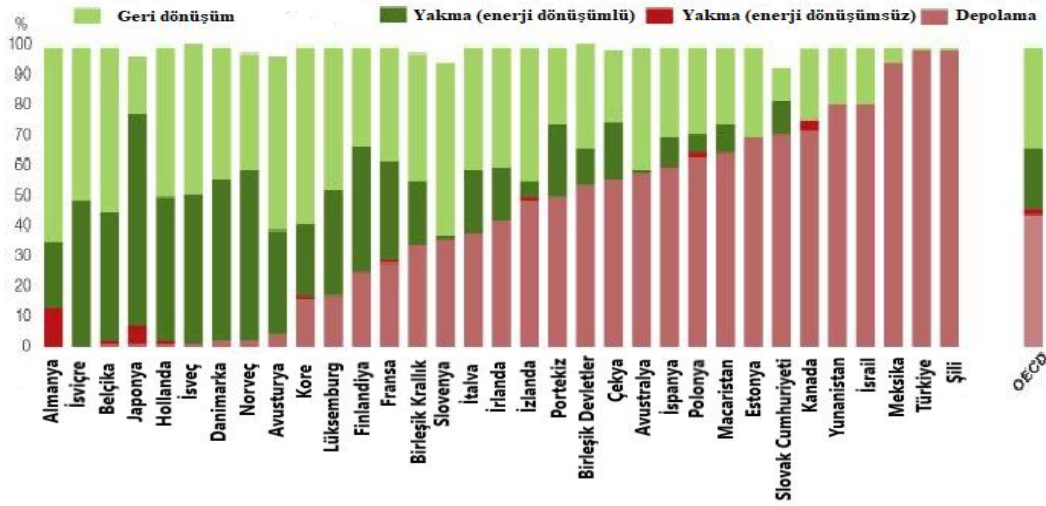


Kaynak: (Ioana, 2010: 170)

Atık yönetiminde temel amaç çevresel kaliteyi arttırmak, insanların sağlığını, sürdürülebilir kalkınmayı ve ekonomik etkinliği gerçekleştirmektir. Bu amaçla atıkların toplama, taşıma, geri kazanım ve geri dönüşüm uygulamaları gerçekleştirilmektedir. Bu uygulamaların hayata geçirilmesinde yerel yönetimlerin gözetiminde kamu ve özel sektör işbirliğinin etkin bir şekilde uygulanması önem arz etmektedir (Yılmaz ve Bozkurt, 2010:16). Şekil 1'de yer alan atık yönetimi hiyerarşisi entegre atık

yönetiminin 6 temel stratejisini ifade etmektedir. Entegre atık yönetimi stratejisi, ortaya konan atık yönetimi hedefine ulaşabilmek için uygun teknoloji ve yönetim programlarının seçilerek hayata geçirilmesi olarak tanımlanabilir (Büyükbektaş ve Varınca, 2008:2). Entegre atık yönetimi son yıllarda dünyada temel kabul gören bir atık yönetimi sürecidir. Böylelikle daha ekonomik, daha verimli ve daha etkili bir atıkla mücadele yürütülmektedir.

Şekil 2. OECD Ülkelerinde Atık Bertaraf Yöntemlerinin Kullanımı (2013)



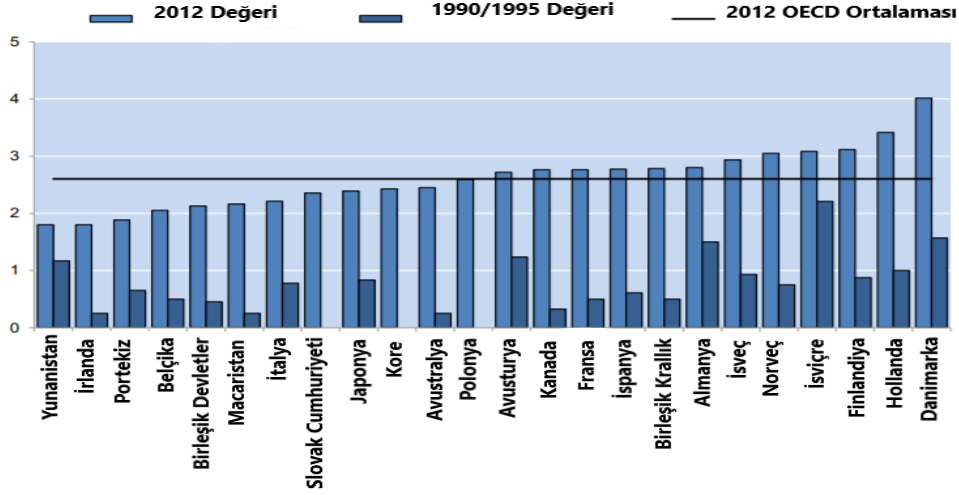
Kaynak: (OECD, 2015:50)

Şekil 2’de OECD ülkelerinin 2013 yılında entegre atık yönetiminin fonksiyonlarına uygun olarak gerçekleştirmiş oldukları atık bertaraf uygulamaları gösterilmektedir. Buna göre Almanya, İsviçre, Belçika, Japonya, Hollanda, İsveç, Danimarka, Norveç ve Avusturya’da atıkların depolanması şeklinde yapılan bertaraf yönteminin oran olarak oldukça düşük olduğu görülebilir. Türkiye’nin de içinde bulunduğu diğer ülkelerde atıkların depolanması oldukça yüksek bir yüzdeye sahiptir. Hatta Meksika, Türkiye ve Şili’de bu oran %100’e oldukça yakındır.

Atıkların bertaraf etmede en etkili yöntem atıkların oluşumunu önlemek olduğu Şekil 1’deki amaç hiyerarşisinde vurgulanmıştır. Bunu gerçekleştirmek için kamu otoritesi çeşitli çevre politikaları uygulamaktadır. Çevre ile ilgili tercih ve amaçların tespit edilmesi geniş anlamda çevre politikası tarafından gerçekleştirilmektedir. Çevre politikası, çevre sorunlarının üstesinden gelmek için geleceğe yönelik atılacak adımların, alınacak tedbirlerin ve benimsenen ilkelerin bütünü olarak tanımlanabilir (Toprak, 2006:151). OECD’nin yayınlamış olduğu Çevre Politikası Katılık Endeksi, ülkelerin uygulamış olduğu çevre politikalarını bir bütün olarak değerlendirip, çevreye zararlı davranışlar

karşısında uygulanan politikaların yaptırım gücünü ölçmektedir. Bu endeks Botta ve Kozluk (2014) metodolojisine dayanmaktadır.

Şekil 3. Seçilmiş OECD Ülkelerinin Çevre Politikası Katılık Endeks Değerleri



Kaynak: (Botta ve Kozluk, 2014:23)

Şekil 2'de geri dönüşüm yöntemini ağırlıklı olarak kullanan ülkelerin Çevre Politikası Katılık göstergeleri Şekil 3'te dikkat edilirse OECD ortalamasının üzerinde yer almaktadır. Atık bertaraf yöntemlerinden depolama oranı yüksek olan ülkelerde ise Çevre Politikası Katılık göstergeleri OECD ortalamasının genelde altında yer almaktadır.

3. ÇEVRESEL POLİTİKALARIN ÇEVRESEL SORUNLAR ÜZERİNDEKİ ETKİSİNİ İNCELEYEN ÇALIŞMALAR

Literatürde Botta ve Kozluk (2014)'ün hazırlanmış ve OECD'nin yayınlamış olduğu çevre politikası katılık endeksini kullanan pek çok çalışma bulunmaktadır. Örneğin Chiara ve Menon (2015) 2005-2010 döneminde 29 ülkede çevreci yatırımların hayata geçirilmesinde çevresel politikaların etkisini incelemişlerdir. Rubashkina v.d (2015) 1997-2009 döneminde çevresel politika katılık endeksini kullanarak 17 Avrupa ülkesinde çevresel politikaların yenilik ve verimlilik üzerindeki etkilerini incelemişlerdir. Elde edilen bulgular çevresel düzenlemelerin teknolojik yeniliklere olumlu etkisi olduğu yönündedir. Albrizio v.d. (2017) OECD ülkelerinde çevresel politika katılığının sektör ve firma düzeyinde verimlilik artışı üzerindeki etkisini analiz etmişlerdir. Araştırmacılar çevresel politikaların katılığının artması ile birlikte özellikle gelişmiş ülkelerde, verimlilikte kısa vadede bir artış olduğu sonucuna ulaşmışlardır. Önder (2017) Çevresel politika endeksinin alt bileşenler bazında kullanarak OECD ülkelerinde hava kirliliğini azaltmadaki etkisini analiz etmiştir. 2005-2012 yılları arasında 25

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

OECD ülkesi üzerine yapılan analizde çevre ile ilgili vergisel düzenlemelerdeki katılığın hava kirliliğini önlemede yardımcı bir politika aracı olduğu sonucuna ulaşmıştır.

Çevresel politikalar ile atık oluşumunu makro bir yaklaşım ile inceleyen çalışmalar nispeten sınırlıdır. D'Amato v.d. (2018) yasadışı atık depolama ile çevresel politikaların katılığını İtalya şehirleri açısından incelemiştir. Yaptığı analizler sonucunda katı bir atık politikasının yasadışı atık bertarafını arttırdığını ortaya koymuştur. Peretz v.d. (1997) Amerika'da atıkların oluşumunu azaltmayı amaçlayan çeşitli kısıtlamalar içeren bir politikanın uygulama sonuçlarını incelemektedir. Elde edilen bulgular uygulanan politikanın özellikle büyük sanayi kuruluşlarında atık oluşumu üzerinde etkili olduğu yönündedir. Dangı v.d. (2017) Nepal'de 1987'de uygulamaya başlanan katı atık yönetmeliğinin etkilerini saha çalışmaları ile ortaya koymaktadır. Yapılan incelemeler sonucunda hazırlanan katı atık yönetmeliğinin yerel ve merkezi kamu otoriteleri arasında hukuksal çatışma alanları yarattığı, yerel ve merkezi yönetimlerin uyum içerisinde çalışmasına engel olduğu sonucuna ulaşmışlardır. Karousakis (2009) 1980-2000 yılları arasında OECD üyesi 30 ülkenin verileri ile yaptığı analiz sonucunda kentleşmenin ve GSYH'nın atık oluşumunu arttırdığı sonucuna ulaşmıştır. Amor ve Hammabi (2017) Tunus'ta madeni yağ atıklarının toplanmasında etkili olan politikaları tespit etmek için bir çalışma yapmıştır. Yaptığı çalışmanın sonucunda kaldırım kenarı atık toplama yönteminin atıkların toplanmasındaki en etkili yöntem olduğu sonucuna ulaşmıştır. Marinescu v.d. (2016) e-atıkların toplanmasında etkili olan sosyo ekonomik faktörleri tespit etmeye yönelik bir çalışma yapmıştır. Bu çalışmanın sonucunda e-atıkların toplanmasında en önemli değişkenin tüketicilerin yaşı olduğu sonucuna ulaşmışlardır.

Türkiye üzerine atık yönetimi ve çevresel politikalar ile makro boyutta yazılmış çalışmalarda son derece sınırlıdır. Bu çalışmalardan Aydın ve Deniz (2017) Türkiye'nin atık yönetiminde vergi politikalarının etkisini incelemiştir. Diğer ülkelerden örnekler ve Türkiye'nin bu alandaki mevzuatının incelendiği çalışmada, Türkiye'nin atık yönetiminde uygulamış olduğu vergisel önlemlerin son derece yetersiz olduğu sonucuna ulaşmışlardır. Toprak (2017) Türkiye'nin çevre politikasında yerel yönetimlerin rolünü incelediği çalışmada, yerel yönetimlerin bütçelerinin daha çevreci olması gerektiği, halkın ve sivil toplum örgütlerini içine alan katılımcı bir anlayışın gerekli olduğunu ifade etmektedir. Şentürk v.d. (2015) Türkiye'de evsel katı atıkların vergilendirilmesinde uygulanan çevre temizlik vergisinin, fayda ilkesi çerçevesinde bir eleştirisini yaptığı çalışmada, tarife yapısı gereği, çevre temizlik vergisinde fayda-vergi ilişkisinin kurulamadığını ifade etmişlerdir.

4. ÇEVRESEL POLİTİKALARIN ATIK YARATMA ÜZERİNDEKİ ETKİSİNİN MODELLENMESİ

Atık Yönetimi Amaç Hiyerarşisinin en önemli tercihi olan atık oluşumunun engellenmesi, ortaya çıkabilecek pek çok çevresel sorunu engelleyebilmektedir. Bu nedenle atık oluşumunu etkileyen faktörlerin makro açıdan tespit edilmesi ve uygulanan çevresel politikaların atık yaratma üzerindeki etkisinin belirlenmesi oldukça önemlidir. Bu çalışmada atık oluşumu üzerinde, makro açıdan etkili olan faktörler ve çevresel politikaların katılığı analiz edilecektir.

$$Atk_{it} = \beta_0 + \beta_1\text{Çep}_{it} + \beta_2\text{Gsyh}_{it} + \beta_3\text{San}_{it} + \beta_4\text{Kent}_{it} + u_{it} \quad (1)$$

Eşitlik 1'de yer alan model bu amaca hizmet etmektedir. Eşitlik 1'de yer alan modelde yer alan değişkenler ve açıklamaları aşağıda verilmektedir. Bu model 26⁵ OECD ülkesinin 2007-2012 yılları arasındaki verileri kullanılarak Dengeli Panel Veri Yöntemi ile analiz edilecektir. Örneklem ülkelerin ve zaman diliminin seçilmesinde verilere ulaşabilmek temel kriter olmuştur. Yapılan analizlerde 156 ülke/yıl verisi kullanılmıştır.

Atk: Bu değişken modelin bağımlı değişkenidir. *i*'nci ülkenin, *t* zamanında üretmiş olduğu kişi başına belediye atık miktarını kilogram (kg) cinsinden göstermektedir. Kişi başına düşen atık miktarları OECD'nin veri bankasından alınmıştır.

Çep: *i*'nci ülkenin, *t* zamanında çevresel politika katılım endeksi değerini göstermektedir. Söz konusu endeks 0 – 6 arasında değer alabilmektedir. Endeks değeri 6'ya yaklaştığı ölçüde ülkenin uygulamış olduğu çevresel politikaların katılığı artmaktadır. Botta ve Kozluk (2014)'ün yapmış olduğu çalışmaya dayanan endeks, OECD'nin veri bankasından alınmıştır. Endeks 14 farklı çevresel politika enstrümanını değerlendirerek oluşturulmuştur.^{es}

Gsyh: *i*'nci ülkenin, *t* zamanında, kişi başına düşen reel GSYH'sını göstermektedir. Bu veri OECD'nin veri bankasından alınmıştır.

San: Değişkeni *i*'nci ülkenin, *t* zamanında, yaratılan katma değerde sanayi sektörünün oranını göstermektedir. Söz konusu veri OECD veri bankasından alınmıştır.

Kent: *i*'nci ülkenin, *t* zamanında, kentleşme oranını göstermektedir. Söz konusu veri OECD veri bankasından alınmıştır.

⁵ Avusturalya, Avusturya, Belçika, Çekya, Danimarka, Finlandiya, Fransa, Almanya, Yunanistan, Macaristan, İrlanda, İtalya, Japonya, Kore, Meksika, Hollanda, Norveç, Polonya, Portekiz, Slovak Cumhuriyeti, İspanya, İsveç, İsviçre, Türkiye, Birleşik Krallık, Birleşik Devletler

Atık oluşumu üzerinde çevresel politikaların katılımı ve sosyo-ekonomik faktörleri makro açıdan inceleyen modelde yer alan değişkenlerin tanımlayıcı istatistikleri Tablo 1’de verilmektedir. Tablo 1’de yer alan değerlere göre örneklem olarak alınan 26 OECD ülkesinin ortalama kişi başına ürettiği atık miktarı 503 kg kadardır. Bu rakamın en düşük olduğu ülkede almış olduğu değer 292 kg iken, en yüksek değere ulaştığı ülkede almış olduğu değer 829 kg’dır. Çevresel politikaların katılımının örneklem içerisindeki ortalaması 2,66’dır. Bu rakam en yüksek ülkede 4,13’e çıkarken, en düşük olduğu ülkede 0,62 değerini almaktadır. Bu değer alabileceği en yüksek değer 6 olduğu düşünülürse örneklem olarak alınan ülkelerin çevresel politika katılımının çok yüksek olmadığı ifade edilebilir. Kişi başına düşen GSYH’nın en düşük olduğu ülkede almış olduğu değer 14357 \$ iken, en yüksek ülkede almış olduğu değer 60430 \$’dır. Bu değişkenin ortalama değeri 35734 olarak bulunmuştur. Yarattığı katma değer içerisindeki sanayi sektörünün ağırlığını gösteren *San* değişkenine ilişkin tanımlayıcı istatistikler incelendiğinde ise ortalama değer %28 olduğu görülmektedir. Sanayinin katma değer içerisindeki payının en yüksek olduğu ülkede %44’e, en düşük olduğu ülkede ise %15’e ulaştığı Tablo 1’den görülmektedir. Örneklem olarak alınan ülkelerin genellikle ortalama olarak %75’ler seviyesinde kentleştiği söylenebilir. Bu rakamın en düşük olduğu ülkede almış olduğu değer %54 iken, en yüksek olduğu ülkede almış olduğu değer %97’lere ulaşmaktadır.

Tablo 1. Tanımlayıcı İstatistikler

| Değişkenler | Ortalama | Standart Hata | En Büyük | En Küçük |
|-------------|----------|---------------|----------|----------|
| <i>Atık</i> | 503.0755 | 131.2161 | 829.4230 | 292.0850 |
| <i>Çep</i> | 2.660844 | 0.702912 | 4.133333 | 0.625000 |
| <i>Gsyh</i> | 35734.29 | 10747.89 | 60430.49 | 14357.04 |
| <i>San</i> | 28.17223 | 5.990365 | 44.73785 | 15.57164 |
| <i>Kent</i> | 75.93095 | 10.53043 | 97.74400 | 54.28000 |

Eşitlik 1’de yer alan modeldeki değişkenlerin, Panel Veri Analizinin varsayımlarını karşılayıp karşılamadığı Tablo 2’de gösterilmektedir. Modelde yer alan değişkenlerin otokorelasyon sorunu olup olmadığı Wooldridge Otokorelasyon Testi ile değişen varyans problemi olup olmadığı Greene Değişen Varyans Testi ile ve kesit bağımlılık problemi olup olmadığı Pesaran Kesit Bağımlılık Testi ile ölçülmüştür. Tablo 2’de yer alan test sonuçlarının istatistiki açıdan %1 önem düzeyinde anlamlı çıkması modelde otokorelasyon, değişen varyans ve kesit bağımlılık problemlerinin var olduğunun bir kanıtı olarak yorumlanmaktadır. Bu problemler Eşitlik 1’de yer alan modelin analiz edilmesinde klasik panel veri tahmincilerinin hatalı katsayılar üretmesine neden olabilecektir. Bu nedenle Eşitlik 1’de yer alan

modeldeki katsayıların tahmin edilmesinde bu problemlere dayanıklı olan Driscoll-Kraay Tahmincisi kullanılacaktır.

Tablo 2. Modelin İstikrar Koşulları

| Hipotez | Test Adı | Test İstatistiği | Olasılık Değeri |
|------------------------------|------------------|------------------|-----------------|
| H_0 : Otokorelasyon Yok | Wooldridge | 18.960 | 0,0002 |
| H_1 : Otokorelasyon Var | Otokor. Testi | | |
| H_0 : Sabit Varyans | Greene Değişen | 11.63712 | 0,0087 |
| H_1 : Değişen Varyans | Varyans Testi | | |
| H_0 : Kesit Bağımlılık Yok | Pesaran's Kesit | 6,064 | 0,0001 |
| H_1 : Kesit Bağımlılık Var | Bağımlılık Testi | | |

Eşitlik 1'de yer alan model Dengeli Panel Veri Yöntemi ile analiz edilecektir. Bu analiz gerçekleştirilirken 3 farklı model kullanılabilir. Bunlar Havuzlanmış Veri Modeli, Rassal Etkiler Modeli ve Sabit Etkiler Modelleridir. Bu modellerden hangisinin kullanılacağına karar verebilmek için F testi, Breusch-Pagan Düzeltmiş Lagrange Testi ve Hausman Testi yapılarak sonuçları Tablo 3'te raporlanmıştır. F Testi ve Breusch-Pagan Testi sonuçlarının olasılık değerlerinin %1 istatistikî önem düzeyinde anlamlı çıkması, Havuzlanmış Veri Seti Modelinin, Rassal Etkiler ve Sabit Etkiler Modelleri karşısında etkin olmadığı şeklinde yorumlanmaktadır. Hausman Testinin olasılık değerinin %1 istatistikî önem düzeyinde anlamlı çıkması ise Rassal Etkiler ve Sabit Etkiler Modellerinden, Sabit Etkiler Modelinin etkin ve tutarlı tahminciler üretebileceğini göstermektedir.

Tablo 3. Analiz Modelinin Seçimi

| Hipotez | Test Adı | Test İstatistiği | Olasılık Değeri | |
|---|--|------------------|-----------------|--------|
| $H_0: \beta_i = \beta$ | F Testi | 65.640035 | 0.0001 | |
| $H_1: \beta_i \neq \beta$ | | | | |
| $H_0: \sigma_u^2 = 0$ | Breusch-Pagan Düz. Lagr. Çarpan Testi | Kesit | 295.1 | 0,0001 |
| $H_1: \sigma_u^2 \neq 0$ | | Zaman | 0.165 | 0.6837 |
| | | Kes.ve Zam | 295.2 | 0,0001 |
| $H_0: E(\varepsilon_{i,t}/x_{it}) = 0$ | Hausman Testi | 24,744 | 0,0001 | |
| $H_0: E(\varepsilon_{i,t}/x_{it}) \neq 0$ | | | | |

Tablo 2 ve Tablo 3'deki sonuçlar Eşitlik 1'de verilen ve atık oluşumunda çevresel politikaların katılığı ve sosyo-ekonomik faktörlerin makro açıdan inceleyen modelin Driscoll-Kraay ve Sabit Etkiler

Modeli ile analiz edilmesi gerektiğini ortaya koymaktadır. Bu yöntemler ile elde edilen analiz sonuçları Tablo 4'te raporlanmaktadır. Tablo 4'te değişkenlerin olasılık değerleri incelendiğinde *San* ve *Kent* değişkenleri istatistiki açıdan sırası ile %10 ve %5 önem düzeyinde anlamlıdır. *Çep* ve *Gsyh* değişkenleri ise istatistiki açıdan anlamlı çıkmamıştır. Modelin F istatistiğinin olasılık değeri modelin genel olarak %1 istatistiki önem düzeyinde anlamlı olduğunu ifade etmektedir.

Tablo 4. Analiz Bulguları

| Değişkenler | Katsayı | Standart Hata | Prob Değeri |
|---------------|----------------|---------------|--------------------|
| <i>Çep</i> | -5,2013 | 4,4244 | 0,293 |
| <i>Gsyh</i> | 0,0022 | 0,0025 | 0,415 |
| <i>San</i> | 4,0769 | 1,8205 | 0,075*** |
| <i>Kent</i> | -8,2135 | 2,3176 | 0,016** |
| C | 945,12 | 210,57 | 0,006* |
| Kesit G. 26 | R ² | | F-istati. 46095,35 |
| Göz. Say. 156 | 0,2361 | | Prob 0.0001* |

*%1, **%5 ve ***%10 istatistiki önem düzeyinde anlamlıdır.

İstatistiki açıdan anlamlı çıkan *San* değişkeni modelin bağımlı değişkeni olan *Atık* değişkeni ile pozitif ilişki içerisindedir. *San* değişkeninde meydana gelebilecek bir birimlik bir değişim, *Atık* değişkenini 4,0769 birim arttırmaktadır. İstatistiki açıdan anlamlı çıkan diğer değişken *Kent* değişkeni, modelin bağımlı değişkeni olan *Atık* değişkeni ile negatif ilişki içerisindedir. *Kent* değişkeninde meydana gelebilecek bir birimlik bir değişim, *Atık* değişkenini 8,2135 birim azaltmaktadır.

5. SONUÇ

Çevre kirliliği günümüz modern ekonomilerinin en temel sorunlarının başında gelmektedir. Bu sorunun ortaya çıkmasında, üretim ve tüketim süreçleri sonucunda ortaya çıkan atıklar temel nedenlerden biridir. Atıklar çevre kirliliğinin temel nedenlerinden biri olmasının yanında, ekonomik bir değerde içermektedir. Pek çok ülke ortaya çıkan atıklardan yeni ürünler üreterek ekonomiye kazandırmayı amaçlamaktadır. Bu nedenle entegre atık yönetimi gibi uygulamalar hayata geçirilmektedir. Entegre atık yönetiminde temel amaç atık oluşumunu en aza indirmektir. Bu temel amacı gerçekleştirebilmek için çeşitli ekonomik, mali ve idari tedbirler almaktadırlar.

OECD ülkelerin uygulamış olduğu çevre politikalarının katılığını ölçmek için çevre politikaları katılık endeksi şeklinde bir istatistik yayınlamaktadır. Ülkelerin çevre politikaları katılık endeks değerlerinin atık oluşumu üzerindeki etkisinin incelendiği bu çalışmanın sonuçları, söz konusu politikaların atık oluşumu üzerinde bir etkisinin olmadığını ortaya koymuştur. Tablo 1'de verilen

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

tanımlayıcı istatistikler örnekleme yer alan ülkelerin katılımının oldukça düşük olduğunu ifade etmektedir. Bu iki sonuç ülkelerin uygulamış olduğu çevre politikalarını en azından atık oluşumu üzerinde yeniden kurgulamaları gerektiğini ortaya koymaktadır. Özellikle geri dönüşümü özendirici ve toplumun gönüllü katılımı teşvik edici politikaların uygulanması faydalı olabilecektir. Ayrıca okul öncesi dönemden başlayan bir bilinç aşılınması, atık konusunda bir kültürün oluşmasına katkı sağlayabilecektir.

Tablo 4'te yer alan sonuçlar özellikle sanayileşmenin atık yaratma üzerinde arttırıcı bir etkisinin olduğunu göstermektedir. Dolayısı ile döngüsel ekonomi yaklaşımına uygun bir şekilde geri dönüşüm ve yeniden kullanma prensiplerine uygun bir sanayileşme atık oluşumunu azaltmada etkili olabilecektir. Tüketim ve üretim kalıplarında çevreci ürünlere ağırlık vererek sanayinin atık oluşumu üzerindeki baskısı hafifletilebilir. Ayrıca elde edilen sonuçlar düzenli bir kentleşmenin atık oluşumunu azaltacağı yönündedir.

KAYNAKÇA

- Albrizio, S., Kozluk, T. ve Zipperer, V. (2017) “Environmental Policies and Productivity Growth: Evidence Across Industries and Firms”, *Journal of Environmental Economics and Management*, 81, 209-226. doi:<https://doi.org/10.1016/j.jeem.2016.06.002>
- Amor, L. B. ve Hammami, S. (2017) “The Determinant Factors for the Rate of Recycling: The Example of Used Lube Oils in Tunisia”, *International Journal of Waste Resources*, 7(1), 1-6.
- Aydın, M. ve Deniz, K. (2017) “Atık Yönetiminde Vergi Politikasının Rolü: Türkiye Değerlendirmesi”, *Journal of Administrative Sciences/Yönetim Bilimleri Dergisi*, 15(30), 435-467.
- Baykal, H. ve Baykal, T. (2008) “Küreselleşen Dünya'da Çevre Sorunları/Environmental Problems in A Globalized World”, *Mustafa Kemal Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 5(9).
- Botta, E. ve Koçluk, T. (2014) “Measuring Environmental Policy Stringency in OECD Countries”, doi:<https://doi.org/10.1787/5jxrjnc45gvg-en>
- Büyükbektaş, F. ve Varınca, K. (2008) “Entegre Atık Yönetimi Kavramı ve AB Uyum Sürecinde Atık Çerçeve Yönetmeliği”, Paper presented at the Üniversite Öğrencileri III. Çevre Sorunları Sempozyumu (ÇESKO), İstanbul.
- Chiara, C. ve Menon, C. (2015) “Environmental Policies and Risk Finance in The Green Sector: Cross-Country Evidence”, *Energy Policy*, 83, 38-56. doi:<https://doi.org/10.1016/j.enpol.2015.03.023>

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES**

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- D'Amato, A., Mazzanti, M., Nicolli, F. ve Zoli, M. (2018) ‘ ‘Illegal Waste Disposal: Enforcement Actions and Decentralized Environmental Policy’’, *Socio-Economic Planning Sciences*, 64, 56-65. doi:https://doi.org/10.1016/j.seps.2017.12.006
- Dangi, M. B., Schoenberger, E. ve Boland, J. J. (2017) ‘ ‘Assessment of environmental policy implementation in solid waste management in Kathmandu’’, *Nepal. Waste Manag Res*, 35(6), 618-626. doi:10.1177/0734242x17699683
- Görmüş, T. (2018) ‘ ‘Atık Yönetimi, Sorunlar Ve Çözüm Arayışları: Antakya Örneği’’, Mustafa Kemal Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, Hatay.
- Gündüzalp, A. A. ve Güven, S. (2016) ‘ ‘Atık, Çeşitleri, Atık Yönetimi, Geri Dönüşüm ve Tüketici: Çankaya Belediyesi ve Semt Tüketicileri Örneği’’, *Hacettepe Üniversitesi Sosyolojik Araştırmalar E-Dergisi*, ISSN, 1304-2823.
- Ioana, I. (2010) ‘ ‘Clean technology from waste management’’, Paper presented at the Advances in Waste Management, 4th WSEAS International Conference on Waste Management, Water Pollution, Air Pollution, Indoor climate (WWAI'10).
- İraz, N. (2018) ‘ ‘Çevre Kirliliği ve Motorlu Taşıtlar Vergisi'nin Çevre Kirliliği Üzerindeki Etkisi’’, Namık Kemal Üniversitesi.
- Karousakis, K. (2009) ‘ ‘The drivers of MSW generation, disposal and recycling: examining OECD inter-country differences’’, In A. Montini & M. Mazzanti (Eds.), *Waste and Environmental Policy* (pp. 113-126): Routledge.
- Kaypak, Ş. (2014) ‘ ‘Çevre Sorunlarının Çözümünde Küresel Çevre Politikaları. Sosyal Ve Beşeri Bilimler Araştırmaları Dergisi, 31: 17-34.
- Marinescu, C., Ciocoiu, C. N. ve Cicea, C. (2016) ‘ ‘Socioeconomic Factors Affecting E-Waste Collection Rate In Countries From European Union’’, Paper presented at the Proceedings of the International Management Conference.
- OECD. (2015) ‘ ‘Environment at a Glance 2015’’, Paris.
- Önder, H. (2017) ‘ ‘Vergilemenin ve Diğer Kamusal Müdahalelerin Hava Kirliliği Üzerinde Etkisi: OECD Ülkeleri Üzerine Bir Analiz’’, *Maliye Dergisi*, 172: 189-200.
- Önder, H. (2018) ‘ ‘Döngüsel Ekonomi ve Avrupa Ülkeleri Üzerine Bir Analiz’’, Bursa: Ekin Yayınevi.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Peretz, J. H., Bohm, R. A. ve Jasiencyk, P. D. (1997) “Environmental Policy and the Reduction of Hazardous Waste”, *Journal of Policy Analysis and Management*, 16(4), 556-574.

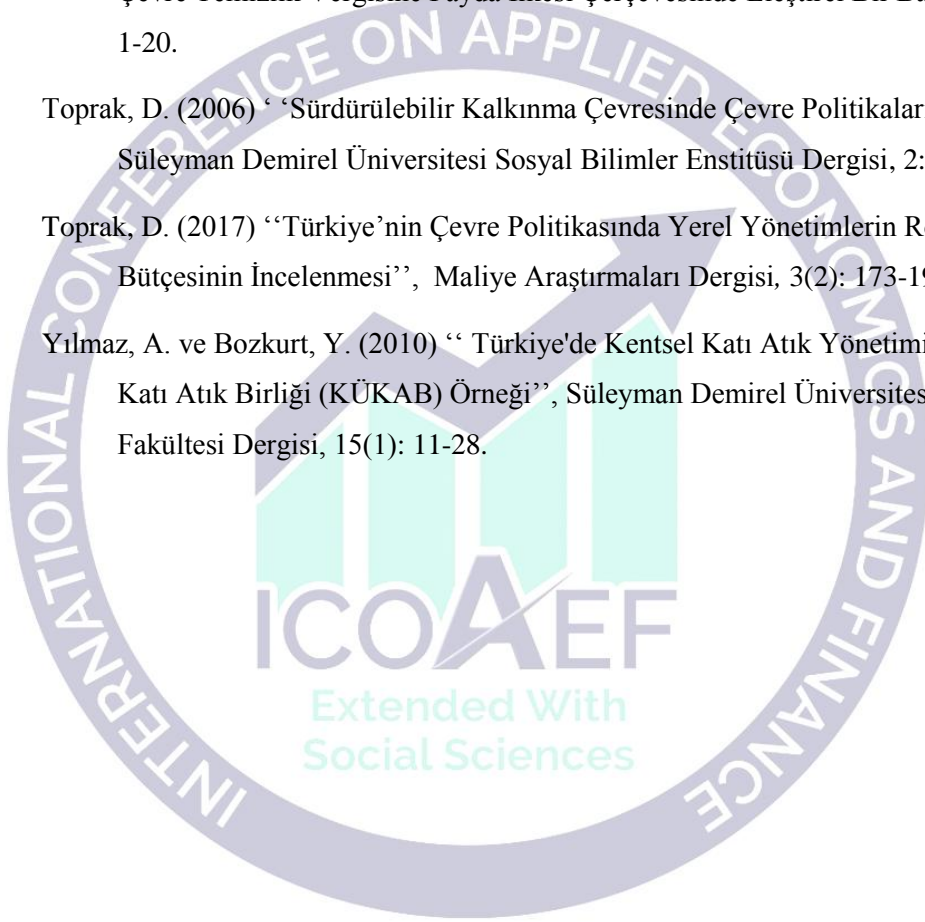
Rubashkina, Y., Galeotti, M. ve Verdolini, E. (2015) “Environmental Regulation and Competitiveness: Empirical Evidence on The Porter Hypothesis from European Manufacturing Sectors”, *Energy Policy*, 83, 288-300. doi:https://doi.org/10.1016/j.enpol.2015.02.014

Şentürk, S. H., Eser, L. Y. ve Polat, S. (2015) “Evsel Katı Atıkların Vergilendirilmesi: Türkiye’de Çevre Temizlik Vergisine Fayda İlkesi Çerçevesinde Eleştirel Bir Bakış”, *Maliye Dergisi*, 169: 1-20.

Toprak, D. (2006) “Sürdürülebilir Kalkınma Çevresinde Çevre Politikaları ve Mali Araçlar”, *Süleyman Demirel Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 2: 146-169.

Toprak, D. (2017) “Türkiye’nin Çevre Politikasında Yerel Yönetimlerin Rolü: Yerel Yönetim Bütçesinin İncelenmesi”, *Maliye Araştırmaları Dergisi*, 3(2): 173-198.

Yılmaz, A. ve Bozkurt, Y. (2010) “Türkiye’de Kentsel Katı Atık Yönetimi Uygulamaları ve Kütahya Katı Atık Birliği (KÜKAB) Örneği”, *Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 15(1): 11-28.



**THE POLITICAL DETERMINANTS OF TRANSPORT FUNDING: AN EXAMINATION OF
THE UNITED STATES**

İsmail Çağrı ÖZCAN*

ABSTRACT

Using the data from Safe, Accountable, Flexible, Efficient Transportation Equity Act (SAFETEA-LU) and Transportation Equity Act for the 21st Century (TEA-21), I test the effects of various political characteristics and posts on the geographic distribution of earmarked transportation funding. My results reveal that certain political posts and delegation characteristics affect the distribution of funding and this in turn leads to legislative malapportionment.

Keywords: *Transport Finance, Pork-Barrel Politics, United States.*

JEL Codes: *P43, L91, L92.*

**ULAŞTIRMA FİNANSMANININ POLİTİK BELİRLEYİCİLERİ: BİRLEŞİK DEVLETLER
ÜZERİNE BİR İNCELEME**

ÖZET

Amerika Birleşik Devletlerindeki Güvenli, Sorumlu, Esnek ve Verimli Ulaştırma Yasası ve 21. Yüzyıl için Ulaştırma Yasası verileri kullanılarak yapılan analizlerde, çeşitli politik faktörlerin ulaştırma ödeneklerinin coğrafi dağılımı üzerindeki etkisi incelenmiştir. Analizlerin sonuçları, belli politik makamlara sahip olmanın ödenek dağılımı üzerinde etkili olduğunu göstermektedir.

Anahtar Kelimeler: *Ulaştırma Finansmanı, Domuz Varili Politikası, Birleşik Devletler.*

JEL Kodları: *P43, L91, L92.*

* Dr., Ankara Yıldırım Beyazıt University, Ankara-Turkey, E-posta: icozcan@ybu.edu.tr

1. INTRODUCTION

Pork barrel⁶ politics have been one of the top agenda items during the last couple transportation authorization acts. The politicians pushed their projects to claim credit for the infrastructure spending to ensure their reelection. However, the greediness of the politicians to bring new public investments to their states and districts sometimes attracted considerable critics like in the case of Gravina Island Bridge (the official name of famous Bridge to Nowhere) of Alaska. The media, the citizen groups, and even some politicians accused such a behavior of pursuing infrastructure projects which will waste public money.

Of course, not all the states are as lucky as Alaska. In fact, no one can expect a small state like Montana to get a share of funding close to that of California. But sometimes it is almost impossible to explain the unequal distribution of funds and earmarked projects just by the population, vehicle traffic, and area variations among the states. If this would be the case, Alaska should have got similar funding patterns with Delaware, North Dakota, South Dakota, Vermont, and Wyoming in the SAFETELU Act⁷. It is obvious there are some political factors which shape the distribution of transportation funds and earmarked projects.

This study attempts to figure out what these political factors might be. Following the related literature, I try to determine these factors and the extent of their impacts on the geographical distribution of federal funds and projects among states. My paper proceeds with a brief literature review. Section 3 will explain the methodology and data. Section 4 will discuss the empirical findings.

2. LITERATURE REVIEW

TEA-21 and SAFETELU Acts brought many policy changes in transportation funding and planning. They both emphasized transit operations and provided authority to local officials in metropolitan areas⁸. In addition to these policy shifts, these two pieces of legislation also launched the mass usage of earmarked projects in transportation.

The political science literature assumes that the primary goal of the politicians (Senators and Representatives in our case) is to be reelected. One way of ensuring this goal is to satisfy the voters by

⁶ Pork barrel can be defined as government spending pushed by the politicians in order to claim credit for reelection and other political benefits.

⁷ Alaska got 3.2% of all earmarked funds while Delaware, North Dakota, South Dakota, Vermont, and Wyoming got 0.68%, 0.59%, 0.88%, 1.02% 0.35% of all earmarked funds.

⁸ However, some researchers believe that more authority to local officials is just an illusion as funding are administrated by the State Transport Department (Edner and McDowell, 2002).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

attracting additional government infrastructure projects and spending to their districts. This cause-effect relation is the basis of the second related assumption of the political science that politicians claim credit for pork-barrel projects they bring to their districts and states. They have a tendency towards common pool incentives, which can be defined as the national financing of local public goods and it is more likely that they will support own-district spending at the expense of other districts (Knight, 2004). In the competition of inserting their pork barrel projects in the legislation texts, some politicians, due to their posts and some other political attributes, have an advantage over others and these relations are analyzed in a couple of studies.

For example, Lee (2003) finds that being a member of Transportation and Infrastructure Committee has a positive effect on getting more pork barrel projects for Representatives while the quantity of this effect is not uniform among all Representatives. More concretely, committee members get \$20 million more transport spending to his/her district than an average nonmember Representative and a Republican member gets around \$16-17 million more spending than a Democrat one. The chair of the committee gets even larger amounts. In a similar study, Wu (2007) tests whether having a Senatorial delegation belonging to the majority party helps attract more federal spending. His analysis reveals that, unlike the general expectation, such a Senatorial delegation has an adverse effect on receiving federal funding.

In addition to such effects, the overrepresentation of small states in the Senate also contributes to malapportionment of federal funds and projects. It is a fact that small states always benefits from federal funding programs as they get more than they contribute. Hauk and Wacziarg (2007) try to figure out this effect in SAFETEALU Act. Their findings show that small states get more per capita funding than larger states.

3. DATA AND MODEL

In this study, I analyze the distribution of transportation funding to the States. Because this study focuses on the impact of political forces and posts within the Congress on transportation funding, I did not include the funding to Washington D.C., Puerto Rico and territories (American Samoa, The Commonwealth of the Northern Mariana Islands, Guam, and The United States Virgin Islands) as these are not represented in the Senate.

For the distribution of funds in TEA-21 and SAFETEALU, I reviewed these two laws section by section and listed the earmarked funds by each state. While some projects are easy to classify, some others are hard to identify. For example, some projects range through multiple states. In such cases, I divided the total funding of the project by the number of beneficiary states and assigned the same amount

***ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES***

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

of funding to each state. To illustrate, SAFETEALU Act mandates that \$8,750,000 per fiscal year between 2006 and 2009 shall be available for design, planning, and right-of-way acquisition for the Interstate Route 74 Bridge from Bettendorf, Iowa, to Moline, Illinois. As there are two beneficiary states in the funding, I divided up \$35,000,000, which is the total funding of \$8,750,000 for 2006, 2007, 2008 and 2009 respectively, and allocated \$17,500,000 to each state.

After listing all earmarked funds and projects by each state, I calculated the share of each state in the total amount of earmarked funds (*FundShare*). I used this variable as the dependent variables of my estimations.

Transportation and Infrastructure Committee of the House was the key committee during the legislation of the two laws analyzed. To measure the impact of this committee, I add three variables, *Tra&InfMem*, *Tra&InfCha*, and *Tra&InfRan* to my estimations. *Tra&InfMem* is the number of representatives from each State who are also a member of the Transportation and Infrastructure Committee. *Tra&InfCha* and *Tra&InfRan* are dummy variables and equal to one for the states whose representatives are the chair and the ranking member of the Transportation and Infrastructure Committee, respectively.

Both TEA-21 and SAFETEALU acts passed when there was a Republican majority at both the Senate and the House. In such a political landscape, one can expect that Republicans may try to ensure their reelection by earmarking more projects and funds to the States having more Republican senators and representatives. In other words, the higher the percentage of Republican senators and representatives from a state, the more its share will be in earmarked projects. To test this hypothesis, I include two variables as *RpSen* and *RpRep* where *RpSen* and *RpRep* stand for the percentage of the Republican senators and representatives from each state, respectively.

Another hypothesis I want to test is about the linkage between the seniority of the Congressmen and their political influence. My expectation is that senior senators and representatives are more likely to include their pork barrel projects in TEA-21 and SAFETEALU acts. To test this hypothesis, I add two variables, *SenSeniority* and *RepSeniority* where *SenSeniority* is the total number of years spent at the Senate and *RepSeniority* is the average number of years of being a representative.

Committee chairs at both the Senate and the House are important political figures. In a struggle of adding their pork-barrel projects, I believe that committee chairs may have a competitive advantage over others as they have strong political tools as a committee chair. I add two variables as *SenComCha* and *RepComCha* where *SenComCha* and *RepComCha* are the number of committee chairs at the Senate and House from each state, respectively. I expect that the more the number of committee chairs from a

state, the more its share in pork-barrel funding will be.

I am also curious about how the leadership structure of the Congress can affect the distribution of the projects. To account this possible effect, I add six dummy variables as *HouSpe*, *ProTempore*, *SenMa*, *SenMin*, *HouseMaj* and *HouseMin* where *HouSpe*, *ProTempore*, *SenMa*, *SenMin*, *HouseMaj* and *HouseMin* stand for speaker of the house, president pro tempore, Senate majority leader, Senate minority leader, House majority leader, and house minority leader, respectively.

For all my political variables, I referred to Congressional Quarterly's Politics in America series. Congressional Quarterly publishes a book for every Congress which includes detailed information about each Congress member.

In order to test whether a malapportionment exists, I need to employ some control variables to determine how much share each state should get in a fair apportionment. I considered several variables such as population, GDP per capita, total area, total highway length, highway density, and vehicles mile traveled (VMT) and run my estimations using many combinations of these control variables. After many iterations, the option to use VMT alone provided the most valid and statistically significant estimates. I gathered VMT statistics from Highway Statistics of Federal Highway Administration for 1998 and 2005

4.EMPRICAL FINDINGS

Table-1 presents the regression results where the percentage share of total earmarked funding is used as a dependent variable. As expected, VMT has a positive and significant impact on the distribution of funding. All else being constant, 1% increase in the share of a state in vehicle-miles traveled increases its percentage share of total earmarked funding by 0.36%. Regression results for also suggest that being a Republican state does not help to get additional transport funding. Besides, although not being statistically significant, having a high percentage of Republican senators or representatives has a negative effect on funding and this finding is similar to that of Wu (2007).

According to the empirical findings, the Transportation and Infrastructure Committee is a key factor in the distribution of transportation funds. All the variables related to Transportation and Infrastructure Committee have positive and statistically significant coefficients. For example, keeping all other variables constant, having one more representative in Transportation and Infrastructure Committee helps the States to receive 0.37% more funding. The Transportation and Infrastructure Committee chair, as deeply experienced in the case of Bridge to Nowhere case, has also a significant

⁹ <http://www.fhwa.dot.gov/policy/ohpi/hss/index.cfm>.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

effect on funding distribution. The Chair of the committee enables its state to get 2.41% more funding which is approximately equal to \$737 million for SAFETEALU Act. To concretize how significant this effect is, it is better comparing 2.41% of share with some loser states in transportation funding. In SAFETEALU Act, Alaska, whose only representative was serving as the chair of Transportation and Infrastructure Committee gets 3.2% (according to model, 2.41% comes from having the chair of the committee) of all the earmarked funds while similar states, in terms of population and VMT, such as Delaware, North Dakota, South Dakota, Vermont, and Wyoming gets only 0.68%, 0.59%, 0.88%, 1.02%, and 0.35% of all earmarked funds, respectively. The picture is also similar in TEA-21 Act. In TEA-21 Act, a representative from Pennsylvania was serving as the chair of transportation and Infrastructure Committee and this state gets 10.43% of all earmarked funds while similar states, in terms of population and VMT, such as Ohio, Illinois, and Florida, gets 2.1%, 4.5%, and 2.45% of all earmarked funds. Regression results also reveal that the ranking member of the Transportation and Infrastructure Committee is also influential in funding distribution. Holding all other variables constant, a state with a ranking member gets 1.04% more of the earmarked funds.

Table 1. Regression Results

| | FundShare |
|--------------|--------------------|
| VMT | 0.363** (2.13) |
| RpSen | -0.002 (-0.33) |
| SenSeniority | 0.021* (1.72) |
| RpRep | -0.001 (0.28) |
| RepSeniority | -0.016 (-0.51) |
| Tra&InfMem | 0.372* (1.72) |
| Tra&InfCha | 2.415*** (2.72) |
| Tra&InfRank | 1.037* (1.88) |
| SenComCha | 0.045 (0.28) |
| RepComCha | 0.541 (1.22) |
| HouSpe | 1.572* (1.86) |
| ProTempore | -0.861 (-1.51) |

| | |
|-------------------|-------------------|
| SenMaj | -0.734 (-1.10) |
| SenMin | -0.351 (-0.72) |
| HouseMaj | -0.663 (-0.54) |
| HouseMin | 1.181 (0.50) |
| Constant | 0.221 (0.42) |
| R2 | 0.550 |
| # of observations | 100 |

Notes: (1) t-statistics in parenthesis based on robust regressions, (2) ***, ** and * stand for significance levels at 1%, 5%, and 10%, respectively.

Parallel to my expectations, seniority of the senators is associated with additional funding. To illustrate, each additional years of Senate experience adds 0.02% more earmarked funding. In the house, however, this relationship is not valid according to the estimation.

Having committee chairs other than those related to transportation does not provide an advantage to the states in transportation funding according to my analysis. Among Congress leaders, only the Speaker of the House seems to have a statistically significant impact on transportation funding. All else being constant, the state where the speaker of the house comes from has 1.57% more earmarked funding.

5.CONCLUSION

This paper provides new evidence on the impact of political factors and characteristics on the geographic distribution of federal transportation funding. The results mostly confirm previous studies and underline the political influences of some key posts within the Congress. My empirical results show that the most politically powerful figure in transportation authorization acts is the chair of Transportation and Infrastructure Committee. He can alone mobilize large amounts of earmarked funds. This study focuses on two pieces of transportation authorization legislation. As a future work, I intend to include the data of other transportation authorization acts and extend the period of my analysis to get more valid estimates.

REFERENCES

- Bickers, K.N., Evans, D., Stein, R.M., Wrinkle, R.D. (2007) "The Electoral Effect of Credit Claiming for Pork Barrel Projects in Congress", Working Paper.
- Brach, A., Wachs, M. (2005) "Earmarking in the US Department of Transportation Research Programs. Transportation research Part a 39: 501-521.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Duncan, P.D., Lawrence, C.L. (1998) Congressional Quarterly's politics in America.

Edner, S., McDowell, B.D. (2002) "Surface-Transportation Funding in a New Century: Assessing One Slice of the Federal Marble Cake", *The Journal of federalism*, 32:7-25.

Evans, D. (1994) "Policy and Pork: The Use of Pork Barrel Projects to Build Policy Coalitions in the House of Representatives", *American Journal of Political Science*, 38: 894-917.

Hauk, W.R., Wacziarg, R. (2007) "Small States, Big Pork", *Quarterly Journal of Political Science*, 2, 95-106.

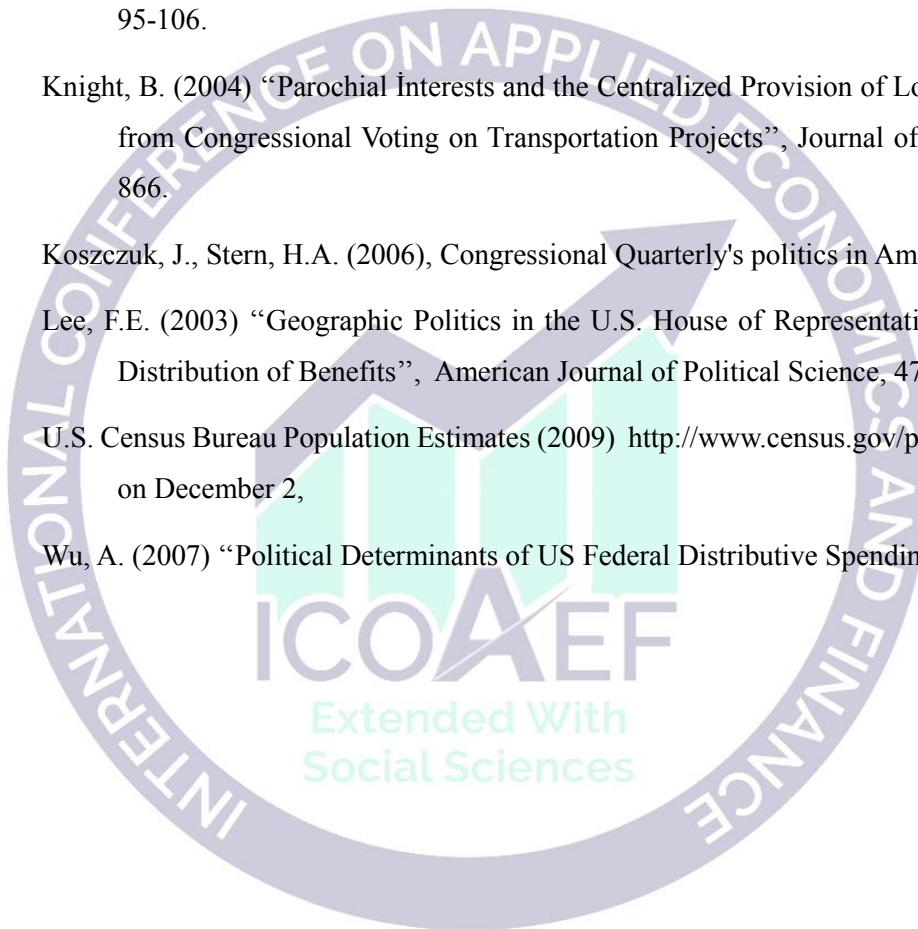
Knight, B. (2004) "Parochial Interests and the Centralized Provision of Local Public Goods: Evidence from Congressional Voting on Transportation Projects", *Journal of Public Economics*, 88: 845-866.

Koszczuk, J., Stern, H.A. (2006), Congressional Quarterly's politics in America.

Lee, F.E. (2003) "Geographic Politics in the U.S. House of Representatives: Coalition Building and Distribution of Benefits", *American Journal of Political Science*, 47: 714-1354.

U.S. Census Bureau Population Estimates (2009) <http://www.census.gov/popest/estimates.html>, visited on December 2,

Wu, A. (2007) "Political Determinants of US Federal Distributive Spending", Working Paper.



**ENFLASYON VE DIŞ TİCARETİN İŞSİZLİK ÜZERİNE ETKİSİ: TÜRKİYE UYGULAMASI
(2008-2018)**

Arş. Gör. Hüseyin GÜVENOĞLU*

ÖZET

Bu çalışmada enflasyonun ve dış ticaretin Türkiye'de işsizlik üzerindeki etkisi 2008-2018 dönemi verileri kullanılarak Johansen eşbütünleşme testi ve Granger nedensellik testi yöntemiyle analiz edilmiştir. Çalışmanın ampirik bulgularına göre, uzun dönemde enflasyon oranındaki artış işsizlik oranını artırırken dış ticaretteki artış işsizlik oranını azaltmaktadır. Granger nedensellik testi sonuçlarına göre ise işsizlikten ve dış ticareten enflasyona doğru tek yönlü, dış ticaret ve işsizlik arasında ise çift yönlü bir nedensellik ilişkisi tespit edilmiştir.

Anahtar Kelimeler: *Enflasyon, Dış Ticaret, İşsizlik, Johansen Eşbütünleşme Testi, Granger Nedensellik Testi*

Jel Sınıflandırması: *E31, F40, E24, C32*

**THE EFFECTS OF INFLATION AND FOREIGN TRADE ON THE UNEMPLOYMENT:
THE APPLICATION OF TURKEY (2008-2018)**

ABSTRACT

In this study, the effect of inflation and foreign trade on the unemployment in Turkey have been analyzed by Johansen cointegration test and Granger causality test method using the data between 2008-2018. According to the empirical findings of the study, the increase in the inflation rate in the long term increases the unemployment rate and the increase in the foreign trade decreases the unemployment rate. According to the results of Granger causality test, a one-way causality relationship from unemployment and foreign trade to inflation and a two-way causality relationship between foreign trade and unemployment was determined.

Key Words: *Inflation, Foreign Trade, Unemployment, Johansen Cointegration Test, Granger Causality Test.*

JEL Classification: *E31, F40, E24, C32*

* Bandırma Onyedi Eylül Üniversitesi, İİBF, İktisat Bölümü Balıkesir, Türkiye, hguvenoglu@bandirma.edu.tr

1.GİRİŞ

İşsizlik, enflasyon ve dış ticaretin yapısı bir ekonominin en önemli makroekonomik göstergeleri arasında yer almaktadır. Nitekim işsizlik, enflasyon ve dış ticaret değişkenleri ekonomik büyüme üzerinde de doğrudan etkili olmaktadır. Söz konusu olgular ekonomilerin hemen hemen her dönemde karşı karşıya kaldıkları sorunlar arasında bulunmaktadır. Resmi otoritelerin işsizlik, enflasyon ve dış ticaretin ekonomik faaliyetler üzerinde olumsuz etkisini önlemek için gerekli tedbirleri alması ve uygun politikaları uygulaması önem arz etmektedir.

İşsizlik, dar anlamda emek girdisinin fiili olarak üretim sürecine katılmaması durumudur. Geniş anlamda ise işsizlik, çalışma çağındaki olan, çalışması için bedensel ve ruhsal sorunu olmayan, cari ücret düzeyinde çalışmaya razı olan, çalışma arzusu olan, iş arayan fakat iş bulamayan işgücünün varlığı olarak tanımlanmaktadır. Bu doğrultuda iş bulamayan işgücünün toplam işgücüne oranı işsizlik oranını göstermektedir (Yıldırım vd., 2008: 352). Günümüzde işsizlik olgusu ülkelerin ekonomik gelişme ve sosyal kalkınma seviyelerinin önemli bir göstergesi olarak karşımıza çıkmaktadır. İşsizlik olgusu Türkiye içinde en önemli sosyo-ekonomik boyutları olan sorunlardan biridir. Türkiye'nin mevcut sosyo-ekonomik yapısındaki aksaklıklar yanında uygulanan makroekonomik politikalar her geçen gün işsizlik olgusunun hissedilmesine yol açmaktadır. İşsizlik sorununun çözülmesi adına işsizliğe neden olan faktörler tespit edilmeli ve soruna odaklı doğru politikaların uygulanması önem teşkil etmektedir (Bozdağlıoğlu, 2008: 45). İşsizliğe neden olan bazı faktörler şunlardır: küreselleşme, dış ticaretin yapısı, döviz kuru, teknolojik gelişmeler, üretim ve yatırım düzeyi, girdi fiyatları, nüfus artışı, vasıfsız emek gücü, eğitim politikaları, kamu kurumlarında istihdam olanaklarının sınırlı olması gibi faktörlerdir (Duruel ve Kara, 2009: 358).

Enflasyon, en yaygın tanımıyla fiyatlar genel düzeyinde yaşanan sürekli artışlar olarak ifade edilmektedir. Enflasyon ayrıca paranın satın alma gücünün azalması şeklinde de tanımlanmaktadır. Bir diğer tanıma göre ise enflasyon, parasal gelirin reel çıktıya oranla daha yüksek orana çıkmasıdır. Yani enflasyon, ekonomik birimlerin reel gelirlerini arttırmak için çalıştıkları veya gelir seviyelerini korumak adına daha çok parasal gelir talebinde bulunmaları durumudur. Ekonomiler için son derece önemli bir makroekonomik gösterge olan enflasyon; bir ülkede gelir düzeyini, gelir dağılımını, istihdam seviyesini, yatırım ve üretim sürecini, borç alacak ilişkisini, dış ticareti, ödemeler bilançosunu, çalışanların ücret ve maaş durumları gibi bir çok ekonomik değişkeni dolaylı ya da doğrudan etkileyebilen bir olgudur (Güven ve Ayvaz, 2016: 242).

Dış ticaret, yurt içinde üretilen mal ve hizmetlerin ulusal sınırların dışında satılması veya yurt dışında üretilen mal ve hizmetlerin satın alınması olarak tanımlanmaktadır. Özetle dış ticaret ülkeler

arasında mal ve hizmet alım satım işlemleridir. Dış ticaretin ihracat ve ithalat olmak üzere iki önemli bileşeni vardır. İhracat, yurtdışında üretilen mal ve hizmetlerin yabancı ülkelere satılması şeklinde ifade edilirken ithalat ise yurtdışında üretilen mal ve hizmetlerin satın alınması şeklinde ifade edilmektedir. Türkiye ekonomisi 1980'li yıllarla birlikte dışa açık ekonomi politikasını benimsemiştir. Bu doğrultuda dış ticaret serbestleşmiş, ithal ikameci sanayileşme politikaları terk edilmiş ve ihracata yönelik sanayileşme stratejileri uygulanmaya başlamıştır. 1989 yılıyla birlikte finansal liberalizasyon sürecine geçilmiş ve böylece dış ticarete tam serbestleşme sağlanmış ve özelleştirmeler artmaya başlamıştır. Bu gelişmeler yaşanırken Türkiye ekonomisinde istikrarlı bir siyasi ortamın olmayışı ve ekonominin kendi iç dinamiklerinin bu gelişmelere tam olarak uygun olmayışı gibi nedenlerden dolayı ekonomik büyümede arzu edilen hedefe ulaşamaması yanında enflasyon başta olmak üzere bazı ekonomik sorunlar ortaya çıkmıştır. Ayrıca bu dönemde Türkiye ekonomisinde uzun süre ithal ikameci sanayi stratejilerin benimsenmiş olması dolayısıyla istenilen düzeyde üretim yapılamamıştır. İthal ikameci stratejilerin benimsenmesi nedeniyle üretimde kullanılan girdilerin fiyatlarındaki artış üretilen malların fiyatlarına yansıtılmış bunun sonucunda da mallara olan talep azalmıştır. Azalan talebe bağlı olarak üretim düşmüş ve dolayısıyla da işsizlik artmıştır (Köse, 2016: 59).

Bu çalışmada enflasyonun ve dış ticaretin işsizlik üzerindeki etkisi Johansen eşbütünleşme testi ve Granger nedensellik testi yöntemiyle analiz edilecektir. Enflasyonun, dış ticaret yapısının ve işsizliğin önemli bir makroekonomik gösterge olması nedeniyle değişkenler arasındaki ilişkinin ortaya konulması çalışmanın amacını oluşturmaktadır. Bu çalışma 5 bölüme ayrılmıştır. Giriş bölümünün yer aldığı birinci bölümde işsizlik, enflasyon ve dış ticaretle ilgili bilgiler verilmiştir. İkinci bölümde enflasyon ile işsizlik ve dış ticaret ile işsizlik arasındaki ilişkiye yönelik kuramsal bilgiler; üçüncü bölümde literatür araştırmaları; dördüncü bölümde ekonometrik yöntem, analiz ve bulgular; beşinci bölümde ise sonuç ve öneriler yer almaktadır.

2.KURAMSAL ÇERÇEVE

Bu bölümde enflasyon ve işsizlik arasındaki ilişki ile dış ticaret ve işsizlik arasındaki ilişkinin kuramsal çerçevesi anlatılacaktır.

2.1.Enflasyon ile İşsizlik İlişkisi

Günümüzde enflasyon ve işsizlik olguları az gelişmiş, gelişmekte olan ve gelişmiş ekonomilerin tamamına yakınında en önemli ekonomik sorunlar arasında görülmektedir. Ekonomiler farklı politikalar uygulayarak bu sorunlardan kurtulma çabası içerisindeyler. Fakat enflasyon ile işsizlik arasındaki ters yönlü ilişki nedeniyle bu iki sorun aynı anda çözülememektedir. Genel olarak enflasyon ile işsizlik arasındaki ters yönlü ilişki Phillips eğrisi ile açıklanmaktadır. Yeni Zelanda'lı ekonomist Alban William

Phillips, 1958 yılında İngiltere ekonomisine ilişkin yaptığı çalışmada parasal ücretler ile işsizlik arasında ters yönlü ilişki tespit etmiştir. Daha sonra Lipsey'de (1960), Phillips ile aynı dönemi kapsayan bir çalışma yapmış ve Phillips ile aynı sonuçlara ulaşmıştır. Böylece enflasyon ile işsizlik arasındaki negatif yönlü ilişkiyi gösteren Phillips eğrisinin temelleri atılmıştır. Samuelson ve Solow (1960), Phillips'in sonuçlarından hareketle yapmış oldukları çalışmalarında enflasyon ve işsizlik oranı arasında negatif yönlü bir ilişki olduğuna fakat bu ilişkinin uzun dönemde geçerli olmayacağına yönelik bulgulara ulaşmışlardır. 1970'li yıllara kadar enflasyon ile işsizlik arasında ters yönlü ilişkinin olduğu Phillips eğrisi yaklaşımı ile genel olarak kabul görmüştür. Fakat 1970'li yaşanan stagflasyon olgusu Phillips eğrisinin geçerliliğinin sorgulanmasına yol açmıştır (Gül vd., 2014: 1). Bu dönemde ekonomilerin hem yüksek enflasyon hem de yüksek işsizlik ile karşı karşıya kalması Phillips eğrisi yaklaşımının bazı teorilerle yeniden ele alınmasına neden olmuştur. İlk olarak Friedman ve Phelps, Phillips eğrisi yaklaşımına adaptif beklentileri ve doğal işsizlik oranını dâhil ederek yeniden bir analiz yapmışlar ve enflasyonla işsizlik arasında kısa dönemde negatif fakat uzun dönemde pozitif yönlü bir ilişkinin olduğu bulgusuna ulaşmışlardır. İkinci olarak Lucas, bireylerin yanılabilirliğini ve zamanla bu yanılığın dönebileceğini varsayarak Phillips eğrisi yaklaşımını rasyonel beklentiler çerçevesinde ele almıştır. Lucas, Friedman ve Phelps tarafından ileri sürülen adaptif beklentiler ve doğal işsizlik oranı hipotezini adaptif beklentiler yerine rasyonel beklentiler hipotezinden yararlanarak yeniden analiz etmiştir. Son olarak ise, Yeni Keynesyenler Phillips eğrisi yaklaşımına enflasyonu hızlandırmayan işsizlik oranı olarak ifade edilen NAIURU'yu ve histeri hipotezi gibi kavramları da ekleyerek yeni bir analiz yapmışlardır. Bir ekonomide NAIURU mevcut işsizlik oranından yüksek ise enflasyon yükselme, NAIURU mevcut işsizlik oranından düşük ise de enflasyon düşme eğilimine girmektedir (Akkuş, 2012: 116). Özetle 1970'li yıllara kadar enflasyonla işsizlik arasında negatif yönlü bir ilişkinin olduğu genel kabul görmüş olsa da 1970'li yıllardan sonra yaşanan stagflasyon olgusu ile birlikte enflasyon ile işsizlik arasında her zaman negatif bir ilişkinin olmayacağı ortaya çıkmıştır. Phillips eğrisi yaklaşımı 1970'li yıllardan sonra sorgulanmaya başlanmış ve bu yaklaşım yeni analizlerle yeniden ele alınmıştır. Yaşanan bu gelişmeler sonucunda da literatürde enflasyon ile işsizlik arasındaki ilişkiyi inceleyen birçok çalışma yapılmıştır. Bu çalışmaların bazılarında iki değişken arasında negatif, bazılarında ise pozitif yönlü bir ilişkinin olduğu tespit edilmiştir

2.2.Dış Ticaret İle İşsizlik İlişkisi

Dış ticaretin ihracat ve ithalat olmak üzere iki bileşeni bulunmaktadır. Dış ticaret ile işsizlik arasında teoride ters yönlü bir ilişkinin olduğu üzerinde durulmaktadır. Bu noktada dış ticaret bileşenlerinin yapısı önem arz etmektedir. Ekonomiler ihracat ve ithalat için farklı politikalar uygulamaktadırlar. Örneğin genel olarak gelişmekte olan ülkeler yurtiçi üretimle uluslararası ticarete

rekabet edemediklerinden dolayı ithalatta korumacı politikalar uygularken, ihracatta ise teşvik ve sübvansiyona ilişkin politikalar uygulamaktadırlar. Ancak Dünya Ticaret Örgütü küresel rekabet nedeniyle uluslararası ticaretin tam olarak serbestleşmesi adına mevcut kotaların, engellerin, vergilerin kaldırılmasına yönelik çalışmalar yapmaktadır (Çütcü ve Cenger, 2017: 69). Uluslararası ticaretteki serbestleşmeler emek piyasasını hem olumlu hem de olumsuz yönde etkilemektedir. Örneğin ihracat ile birlikte iş bölümü ve uzmanlaşma aracılığıyla kıt kaynaklar daha etkin dağılarak ticaret yapan ülke ekonomilerinin büyümelerine katkı sağlanmış olmaktadır. Ayrıca ihracat ile birlikte yeni sektörlerin mevcut piyasaya girmeleri sağlanmış olmakta ve böylece yeni istihdam alanları oluşturulmaktadır. Ancak genel olarak gelişmekte olan ekonomilerin üretimlerinin ithalata bağımlı olması cari açık sorununa ve istihdam olanaklarının azalmasına yol açabilmektedir (Sandalcılar ve Yalman, 2012: 50).

Küreselleşme olgusu ile birlikte dünyada ticaret hacmi ve üretim hacmi arasındaki makasın giderek açılmasına karşın işsizlik sorununun giderilememesi dış ticaret ile istihdam konusunun daha ilgi çekici hale gelmesine neden olmuştur. Dış ticaretin istihdam üzerindeki etkisi uluslararası ticaret teorilerinde Merkantilistler ile birlikte tartışılmaya başlanmış daha sonra Hecksher–Ohlin (HO) modelinde de yerini almıştır. Dış ticaretin istihdam üzerindeki etkisi günümüzde de tartışılmaya devam etmektedir. HO modeline göre, dış ticaretteki uzmanlaşma bol miktarda bulunan üretim faktörünün yoğun bir şekilde kullanıldığı ürün üzerinden gerçekleşmekte ve bunun sonucunda da dış ticaret ile istihdam arasındaki ilişkinin yönü belirlenmektedir. HO modeline göre bir ülke en fazla sahip olduğu üretim faktörünü üretim sürecinde kullanarak uzmanlaşır. Böylece diğer ülkelerden daha ucuza üretmeye başlar ve karşılaştırmalı üstünlük elde etmiş olur. Dış ticaret ve uzmanlaşma sayesinde bol miktarda sahip olunan üretim faktörünün fiyatı artacaktır. Emek faktörünün çok olduğu gelişmekte olan bir ülkede dış ticaret ile emek yoğun sektörlerde üretim daha fazla olacaktır bu da istihdamın artmasını sağlayacaktır. Fakat emeğin yoğun olarak kullanıldığı bir ülkede dış ticaret arttıkça sermaye sektörlerindeki üretim azalacak ve buna bağlı olarak da istihdamda azalmalar yaşanabilecektir. OH modelinde uluslararası ticaretin yapılmasındaki temel nedenin faktör fiyatları arasındaki farklılıktan yararlanarak kara geçmek olmasına rağmen artan ticaret faktör fiyatları arasındaki farklılığı ortadan kaldırmaktadır. Bu noktada Samuelson'un geliştirdiği faktör fiyatları eşitliği teoremi, HO modeline uygulanmış ve Hecksher–Ohlin–Samuelson (HOS) modeli oluşturulmuştur. HOS modeline göre, emeğin yoğun olarak üretim sürecinde kullanıldığı bir ülkede üretim arttıkça emek talebi de artacaktır. Buna bağlı olarak da hem istihdam artacak hem de emeğin fiyatı olan reel ücretler artacaktır. Bu durum sermayenin nispi fiyatını düşürmekte ve gelişmekte olan ülkelerde üretim verimliliğiyle birlikte istihdamda artışa yol açmaktadır. HO modelinde emek ve sermaye olmak üzere iki faktörlü bir gelişmekte olan ülkelerin emek yoğun malları ihraç edeceği, sermaye yoğun malları ise ithal edeceği

tahmin edilmektedir. Böylelikle gelişmekte olan ülkeler dünya ekonomilerine entegre olacak ve uluslararası ticarete yerlerini alacaklardır. Bu durum yurtiçi emek talep eğrisinin sağa kaymasına ve dolayısıyla istihdamda artışa neden olabilecektir. Özetle üretim sürecinde emek faktörünün yoğun olarak kullanıldığı ekonomilerde emek talebi artacağı için istihdam artacaktır. Üretim sürecinde sermaye faktörünün yoğun olarak kullanıldığı ekonomilerde ise sermaye yoğun mallarda üretim arttıkça emek yoğun malların üretimi azalmakta ve dolayısıyla istihdam azalmaktadır (Gül ve Kamacı, 2012: 24).

3.LİTERATÜR ARAŞTIRMALARI

Enflasyon ve dış ticaret ile işsizlik arasındaki ilişkinin incelendiği bazı uluslararası çalışmalar şunlardır: Phillips, A.W. (1958), çalışmasında İngiltere'de 1861-1957 dönemi için işsizlik oranı ile parasal ücretlerdeki değişme oranı arasındaki ilişkiyi incelemiş ve değişkenler arasında ters yönlü ilişki tespit etmiştir. Samuelson ve Solow (1960), çalışmalarında işsizlik ile enflasyon arasındaki ilişkiyi incelemişler ve işsizlik oranının % 3'e düştüğünde, enflasyon oranının % 4,5'a çıktığını tespit etmişlerdir. Krugman vd. (1995), çalışmalarında ABD ve İngiltere'de dış ticaret ile işsizlik arasındaki ilişkiyi incelemişler ve dış ticaretle birlikte vasıfsız işgücü ücretlerinin azaldığını ve buna bağlı olarak da işsizliğin arttığını tespit etmişlerdir. Noel ve Trefler (1997), çalışmalarında Kanada 'da 1980-1993 dönemine ait yıllık verileri kullanarak dış ticaret ile işsizlik arasındaki ilişkiyi incelemişler ve ihracattaki artışın istihdamı artırdığına, ithalattaki artışın ise istihdamı azalttığına yönelik bulgulara ulaşmışlardır. Valadkhani (2003), çalışmasında İran'da 1968-2000 dönemi için yıllık veriler kullanarak işsizliğin nedenlerini eşanlı denklemlerle incelemiş ve işsizlik ile enflasyon arasında pozitif yönlü bir ilişki bulmuştur. Fu ve Balasubramanyam (2005), çalışmalarında Çin'de 1987-1998 dönemi için ihracatın işgücü talebine etkisini panel veri analiziyle incelemişler ve ihracatın istihdam üzerinde pozitif etkiye sahip olduğunu tespit etmişlerdir. Castro vd. (2006), çalışmalarında Çin, Hindistan ve Arjantin'de 1991-2003 dönemi için dış ticaretin istihdam üzerine etkisini incelemişler ve Çin'de ve Hindistan'da ticari serbestleşmenin istihdamı olumsuz etkilediğini tespit etmişlerdir. Dutt vd. (2009), çalışmalarında 92 ülkede 1985-2004 dönemi için dış ticaret ile işsizlik arasındaki ilişkiyi panel veri analiziyle incelemişler ve dış ticaretin işsizliği artırdığına yönelik bulgulara ulaşmışlardır. Chinembiri (2010), çalışmasında Güney Afrika'da 1970-2008 dönemi için dış ticaretin istihdama etkisini incelemiş ve ithalat artışının işgücü talebini olumsuz etkilediğini tespit etmiştir. Altay vd. (2011), çalışmalarında G8 ülkelerinde 2000:01-2009:04 dönemi için üçer aylık verileri kullanarak enflasyon ve işsizlik arasındaki ilişkiyi Panel veri analizi ve Granger nedensellik analiziyle incelemişler ve iki değişken arasında ters yönlü bir ilişki tespit etmişlerdir. Ketan (2017), çalışmasında G8 ülkelerinde 1997-2014 dönemi için yıllık verileri kullanarak işsizlik ve enflasyon arasındaki ilişkiyi eşbütünleşme, nedensellik testleriyle incelemiş ve enflasyondan işsizliğe doğru tek yönlü bir ilişki tespit etmiştir.

Türkiye’de enflasyon ve dış ticaret ile işsizlik arasındaki ilişkinin incelendiği bazı çalışmalar şunlardır: Erlat (2000), çalışmasında 1963-1994 dönemi için dış ticaretin istihdam üzerindeki etkisini incelemiş ve ihracattaki artışların istihdamı olumlu yönde etkilediği bulgusuna ulaşmıştır. Uysal ve Erdoğan (2004), çalışmalarında 1980-2002 dönemi için yıllık verileri kullanarak enflasyon oranı ile işsizlik oranı arasındaki ilişkiyi regresyon analizi ile incelemişler ve 1980’li yıllarda iki değişken arasında pozitif yönlü, 1990’lı yıllarda ise negatif yönlü ilişki tespit etmişlerdir. Polat ve Uslu (2010), çalışmalarında 1988:1- 2007:3 dönemi için üçer aylık verileri kullanarak dış ticaretin istihdam üzerindeki etkisini ARDL yaklaşımıyla incelemişlerdir. Analiz sonucunda uzun dönemde dış ticaretin istihdam üzerinde anlamlı bir etkisinin olmadığına fakat kısa dönemde ihracatın ve ithalatın istihdam üzerinde pozitif ve anlamlı bir etkiye sahip olduğuna yönelik bulgulara ulaşmışlardır. Gözgör ve Pişkin (2011), çalışmalarında Düzey 2 olarak belirlenen 26 bölgede 2004–2009 dönemi için yıllık verileri kullanarak işsizlik oranı ile bölgelerin dış ticarettten aldıkları pay arasındaki ilişkiyi Sabit Etkili Panel Veri ve Genelleştirilmiş Momentler yöntemleriyle incelemişlerdir. Analiz sonucunda bölgelerin dış ticarettten aldıkları paylardaki artışın işsizlik oranını azalttığına yönelik bulgulara ulaşmışlardır. Çiftçi ve Çapkın (2013), çalışmalarında 1988-2012 dönemi için yıllık verileri kullanarak cari açık ile işsizlik arasındaki ilişkiyi Johansen eşbütünlük ve Granger nedensellik testleriyle incelemişler ve serilerin uzun dönemde eşbütünlük olduklarını ve işsizlikten cari açığa doru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi tespit etmişlerdir. Ulusoy ve Dibo (2016), çalışmalarında Çorum ilinde 2005-2014 dönemi için yıllık verileri kullanarak enflasyon ve işsizlik arasındaki ilişkiyi Pearson ve Spearman korelasyon yöntemleriyle incelemişler ve işsizlik ile enflasyon arasında istatistiki olarak anlamlı bir ilişki bulamamışlardır. Çütücü ve Cenger (2017), çalışmalarında 2005:01-2017:03 dönemi için aylık verileri kullanarak dış ticaret ile işsizlik arasındaki ilişkiyi yapısal kırılmalı zaman serisi yöntemleriyle, eşbütünlük ve nedensellik testleriyle incelemişler ve değişkenler arasında uzun dönemde bir ilişki tespit edememişlerdir. Kısa dönemde ise ihracat ve ithalat değişkenleri ile işsizlik arasında karşılıklı nedensellik ilişkisi tespit etmişlerdir. Eygü (2018), çalışmasında 1990-2017 dönemi için yıllık veriler kullanılarak enflasyonun ve dış ticaretin işsizlik üzerindeki etkisini çoklu regresyon modeliyle analiz etmiş ve enflasyon ve dış ticaret ile işsizlik arasında negatif yönlü bir ilişki tespit etmiştir.

4.YÖNTEM, ANALİZ VE BULGULAR

Bu çalışmada, 2008:01-2018:08 dönemine ilişkin aylık veriler kullanılarak, Türkiye’de enflasyonun ve dış ticaretin işsizlik üzerindeki etkisinin ortaya konulması amaçlanmıştır. Çalışmada işsizlik oranı (UNE) bağımlı değişken olarak modelde yer alırken enflasyon verisi olarak kullanılan tüketici fiyat endeksi (TUFİ) ve dış ticaret verisi olarak kullanılan ihracatın ithalatı karşılama oranı (FT) bağımsız değişken olarak modelde yer almaktadır. Söz konusu değişkenler logaritmaları alındıktan

sonra modele dahil edilmiştir. Değişkenlere ilişkin veriler Türkiye İstatistik Kurumundan (TÜİK) elde edilmiştir. Enflasyonun ve dış ticaretin işsizlik üzerindeki etkisini inceleyeceğimiz çalışmada oluşturulan ekonometrik model aşağıda gösterilmiştir.

$$UNE_t = \beta_0 + \beta_1 TUF E_t + \beta_2 FT_t + \varepsilon_t \quad (1)$$

Çalışmada ilk olarak serilere durağanlık testi, daha sonra seriler arasında uzun dönemli bir ilişkinin olup olmadığının tespit edilmesi için Johansen Eşbütünlük testi ve son olarak da seriler arasında herhangi bir nedensellik ilişkisinin olup olmadığının ortaya konulması ve bir nedensellik varsa bu nedenselliğin yönünün belirlenmesi için Granger nedensellik testi yapılmıştır.

Modelde yer alan serilere ilişkin durağanlık analizleri Dickey ve Fuller (1981) tarafından geliştirilen Augmented Dickey-Fuller (ADF) birim kök testi ve Phillips ve Perron (1988) tarafından geliştirilen Phillips ve Perron (PP) birim kök testiyle yapılmıştır. Söz konusu birim kök testlerinin yapılması sonucunda serilerin bütünlük dereceleri belirlenmiştir (Sandalcılar ve Yalman, 2012: 57).

Tablo 1’de değişkenlere yönelik ADF ve PP birim kök testi sonuçları gösterilmiştir. Modelde kullanılan değişkenlerin düzey hallerinin durağan olmadığı fakat birinci farkları alındığında yani seriler I(1) olduklarında tüm değişkenlerin % 1 anlamlılık düzeyinde durağan hale geldiği Tablo 1’de görülmektedir.

Tablo 1. ADF ve PP Birim Kök Testi Sonuçları

| DEĞİŞKENLER | ADF | | PP | |
|-------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|
| | I(0) | I(1) Δ | I(0) | I(1) Δ |
| UNE | {-2,0677} [0,5582] | {-7,3548} [0,000]* | {-1,8138} [0,6924] | {-7,8121} [0,0000]* |
| TUFE | {-1,8993} [0,6491] | {-13,0747} [0,0000]* | {-1,5077} [0,8221] | {-14,4877} [0,0000]* |
| FT | {0,1767} [0,7359] | {-9,1350} [0,0000]* | {0,3743} [0,7910] | {-19,1044} [0,0000]* |

Not: Parantez içindeki değerler { } t-istatistik değerlerini, köşeli parantez içindeki değerler [] MacKinnon kritik değerlerini, * sembolü değişkenin % 1 düzeyinde anlamlı olduğunu, Δ sembolü değişkenlerin birinci farkını göstermektedir.

Durağanlık analizi sonucunda serilerin aynı düzeyde durağan olduğu tespit edilmiştir. Serilerin aynı düzeyde durağan hale gelmesi, seriler arasındaki uzun dönemli ilişkinin belirlenmesi için yapılacak olan eşbütünlük testi için gerekli olan ön şartın sağlandığı anlamına gelmektedir. Seriler arasında eşbütünlük ilişkisinin tespit edilmesi için geliştirilen ilk testlerden birisi Engle-Granger (1987) tarafından geliştirilmiştir. Engle-Granger’e göre uzun dönemde seriler arasında bir ilişkinin olması serilerin eşbütünlük olduğuna işaret etmektedir. Johansen (1988), Engle-Granger’ın (1987) eşbütünlük testinin bazı eksiklikler içerdiğini öne sürerek çoklu eşbütünlük testini geliştirmiştir. Johansen’in (1988) eşbütünlük testi ile hem eşbütünlük olan vektörler tahmin edilip test edilmekte

hem de parametrelere yönelik bir takım sınırlamalar test edilmektedir (Kılıç ve Torun, 2018: 27). Johansen eşbütünlük analizi yapılırken eşbütünlük vektör sayılarının tahmin edilmesinde İz (trace) istatistiği ve maksimum özdeğer (max-eigenvalue) istatistiği olmak üzere iki test istatistiğinden yararlanılmaktadır (Sandalcılar, 2012: 281).

Tablo 2’de değişkenlere ait Johansen eşbütünlük testi sonuçları gösterilmiştir. Tablo 2’deki sonuçlardan hem iz istatistik değerlerinin hem de maksimum özdeğer istatistik değerlerinin % 5 anlamlılık düzeyindeki kritik değerlerden büyük olduğu görülmektedir. Bu bulgular bize en fazla iki tane eşbütünlük vektör ilişkisinin olduğunu göstermektedir. Bu sonuçlar enflasyon ve dış ticaret ile işsizlik arasında uzun dönemli bir ilişkinin olduğuna işaret etmektedir.

Tablo 2. Johansen Eşbütünlük Testi Sonuçları

| Hipotezler | İz İstatistiği | % 5 (0,05) Kritik Değer | Olasılık Değeri |
|------------|----------------|-------------------------|-----------------|
| None | 94,0797 | 35,1927 | 0,0000 |
| At most 1 | 46,5576 | 20,2618 | 0,0000 |
| At most 2 | 18,1207 | 9,1645 | 0,0008 |

| Hipotezler | Maz-Özdeğer İstatistiği | % 5 (0,05) Kritik Değer | Olasılık Değeri |
|------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| None | 47,5220 | 22,2996 | 0,0000 |
| At most 1 | 28,4369 | 15,8921 | 0,0003 |
| At most 2 | 18,1207 | 9,1645 | 0,0008 |

Eşbütünlük vektörü UNE’nin katsayısına göre normalize edildiğinde seriler arasındaki ilişki şu şekilde olmaktadır.

$$\Delta UNE = -0,22427 + 7,500893 \Delta TUFE - 2,372439 \Delta FT \quad (2)$$

(1,69433) (0,32309)

2’ncü denkleme göre uzun dönemde enflasyon ile işsizlik arasında pozitif yönlü bir ilişki bulunurken, dış ticaret ile işsizlik arasında negatif yönlü bir ilişki bulunmaktadır. 2’ncü denkleme göre $\Delta TUFE$ ’de meydana gelen % 1 birimlik artış ΔUNE ’yi % 7,5 birim artırmaktadır. Fakat ΔFT ’de meydana gelen % 1 birimlik artış ΔUNE ’yi % 2,37 birim azaltmaktadır.

Çalışmada kullanılan son test nedensellik testidir. Bu test, iki değişken arasında bir nedensellik ilişkisinin olup olmadığını belirlemesi ve eğer nedensellik ilişkisi varsa bu nedenselliğin yönünün tespit edilmesinde kullanılan bir testtir. Granger’in (1969) geliştirdiği Granger nedensellik testi, zaman

serileri arasındaki ilişkinin belirlenmesinde kullanılan en sık yöntem olarak karşımıza çıkmaktadır (Ekinci, 2011: 81).

Tablo 3'te değişkenlere ait Granger nedensellik testi sonuçlarına yer verilmiştir. Granger nedensellik testi sonuçlarına göre işsizlikten ve dış ticareten enflasyona doğru tek yönlü, dış ticaret ve işsizlik arasında ise çift yönlü bir nedensellik ilişkisi tespit edilmiştir.

Tablo 3. Granger Nedensellik Testi Sonuçları

| Hipotezler | F-İstatistiği | Olasılık |
|---|----------------------|-----------------|
| Δ TUFE, Δ UNE'nin Granger Nedeni Değildir | 0,9307 | 0,4640 |
| Δ UNE, Δ TUFE'nin Granger Nedeni Değildir | 2,1810 | 0,0613*** |
| Δ FT, Δ UNE'nin Granger Nedeni Değildir | 2,2182 | 0,0574*** |
| Δ UNE, Δ FT'nin Granger Nedeni Değildir | 6,3567 | 3.E-05* |
| Δ FT, Δ TUFE'nin Granger Nedeni Değildir | 2,5516 | 0,0317** |
| Δ TUFE, Δ FT'nin Granger Nedeni Değildir | 0,1758 | 0,9711 |

Not: * sembolü değişkenin % 1 düzeyinde, ** sembolü değişkenin % 5 düzeyinde ve *** sembolü değişkenin % 10 düzeyinde anlamlı olduğunu göstermektedir.

5.SONUÇ VE ÖNERİLER

Çalışmada Türkiye'de enflasyonun ve dış ticaretin işsizlik üzerindeki etkisi 2008:01-2018:08 dönemine ilişkin aylık veriler kullanılarak analiz edilmiştir. Çalışmada ilk olarak modelde kullanılacak seriler ADF ve PP birim kök testleri ile sınanmıştır. Serilerin düzey halde iken durağan olmadığı fakat birinci farkları alındığında durağan hale geldikleri tespit edilmiştir. Serilerin aynı düzeyde I(1) durağan hale gelmesi ile uzun dönemli ilişkinin belirlenmesi için Johansen eşbütünleşme testi yapılmış ve serilerin uzun dönemde bütünlük olduğu bulgusuna ulaşılmıştır. Johansen eşbütünleşme analizi sonucunda enflasyon oranında meydana gelen % 1 birimlik artışın işsizlik oranını % 7,5 birim artırdığı yani enflasyon ile işsizlik oranı arasında pozitif yönlü bir ilişkinin olduğu bulgusuna ulaşılırken, dış ticaret değişkeninden meydana gelen % 1 birimlik artışın işsizlik oranını % 2,37 birim azalttığı yani dış ticaret değişkeni ile işsizlik arasında ters yönlü bir ilişkinin olduğu bulgusuna ulaşılmıştır. Çalışmada son olarak değişkenler arasında bir ilişkinin olup olmadığının ve eğer ilişki varsa bu ilişkinin yönünün belirlenmesi için Granger nedensellik testi uygulanmıştır. Granger nedensellik testi sonucunda işsizlikten ve dış ticareten enflasyona doğru tek yönlü, dış ticaret ve işsizlik arasında ise çift yönlü bir nedensellik ilişkisi tespit edilmiştir.

İşsizlik üretim sürecinde emek girdisinin atıl kalan kısmını, enflasyon satın alma gücünün azalmasını, dış ticaret de bir ekonominin ne kadar mal üretip sattığını ve ne kadar malı dışarıdan satın aldığını göstermesi nedeniyle önemli makroekonomik göstergeler arasında yer almaktadır. Resmi otoriteler düşük bir işsizlik oranını, düşük ve istikrarlı bir enflasyon oranını ve ihracat gelirlerinin ithalat giderlerinden fazla olduğu bir dış ticaret yapısını arzu etmektedirler. Bu doğrultuda da hedeflerini

belirlemede ve politikalar yürütmektedirler. Resmi otoriteler ekonomiye yönelik politikalarını belirlerken üretim, yatırım, ihracat ve istihdam gibi önemli değişkenleri göz önünde bulundurmalıdır. Ayrıca bu çerçevede enflasyona neden olan faktörler tespit edilmeli, enflasyonla mücadele politikaları ön planda tutulmalı, işsizliğe neden olan yapısal sorunlar giderilmeli, işgücüne katılım oranı artırılmalı, uluslararası ticarete konu olabilecek mallar üretilmeli, yurtiçi şirketlerin uluslararası ticarete rekabet gücü artırılmalıdır.

KAYNAKÇA

- Akkuş, G. Emel (2012) “Phillips Eğrisi: Enflasyon İşsizlik Değiş Tokuşu Teorik Bir İnceleme”, İktisat Fakültesi Mecmuası, 62(2): 99-151.
- Altay, B., Tuğcu, C.T. ve Topçu, M. (2011) “İşsizlik ve Enflasyon Oranları Arasındaki Nedensellik İlişkisi: G8 Ülkeleri Örneği”, Afyon Kocatepe Üniversitesi İİBF Dergisi, 8(2): 1-26.
- Bozdağlıoğlu, U.E.Y. (2008) “Türkiye’de İşsizliğin Özellikleri Ve İşsizlikle Mücadele Politikaları”, Sosyal Bilimler Dergisi, 20: 45-65.
- Castro, L., Olarreaga, M. ve Saslavsky, D. (2006) “The Impact of Trade With China and India on Argentina’s Manufacturing Employment”, MPRA Paper, 538: 1-27.
- Chinembiri, Evans K. (2010) “An Empirical Assessment Of The Impact Of Trade Liberalization On Employment in South Africa”, Trade & Industrial Policy Strategies, 1-20.
- Çifti, N. ve Çapkın, D. (2013) “Türkiye Ekonomisinde Cari Açık ve İşsizlik Arasındaki İlişkinin Var Tekniği İle Analizi”. İnönü Üniversitesi Uluslararası Sosyal Bilimler Dergisi, 2(2): 157-182.
- Çütücü, İ. ve Cenger, E. (2017) “Türkiye’de Dış Ticaret ve İşsizlik Arasındaki İlişki: Yapısal Kırılmalı Zaman Serisi Analizi”, III. Uluslararası Girişimcilik, İstihdam ve Kariyer Kongresi, 12-15 Ekim, Muğla/Türkiye, 67-82.
- Duruel, M. ve Kara, M. (2009) “Küresel İşsizlik ve İstihdamda Yeni Perspektifler”, Sosyal Siyaset Konferansları Dergisi, 57: 357-379.
- Dutt, P., Mitra, D. ve Ranjan, P. (2009) “International Trade and Unemployment: Theory and Cross – National Evidence”, Journal of International Economics, 78: 32–44.
- Ekinci, A. (2011) “Doğrudan Yabancı Yatırımların Ekonomik Büyüme ve İstihdama Etkisi: Türkiye Uygulaması (1980-2010)”, Eskişehir Osmangazi Üniversitesi İİBF Dergisi, 6(2): 71-96.
- Erlat, Güzin (2000) “Measuring The Impact Of Trade Flows On Employment In The Turkish Manufacturing Industry”, Applied Economics, 32: 1169-1180.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Eygü, H. (2018) “Enflasyon, İşsizlik ve Dış Ticaret Arasındaki İlişkinin İncelenmesi: Türkiye Örneği (1990-2017)”, Kastamonu Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 20(2): 96-112.
- Fu, X. ve Balasubramanyam, V.N. (2005) “Exports, Foreign Direct Investment and Employment: The Case of China”, The World Economy, 607-625.
- Gözgör, G. ve Piskin, A. (2011) “İşsizlik ve Dış Ticaret: Türkiye’deki Bölgeler İçin Genelleştirilmiş Momentler Yöntemi-Dinamik Panel Veri Yaklaşımı”, Business and Economics Research Journal, 2(3): 121-138.
- Gül, E. ve Kamacı, A. (2012) “Dış Ticaretin İstihdam Üzerindeki Etkileri: Bir Panel Veri Analizi”, Anadolu Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 12(4): 23-32.
- Gül, E., Kamacı, A. ve Konya, S. (2014) “Enflasyon ile İşsizlik Arasındaki Nedensellik İlişkisinin Test Edilmesi: Panel Eşbütünlük ve Nedensellik Analizi”, International Conference on Eurasian Economies, 1-6.
- Güven, E.T. ve Ayvaz, Y.Y. (2016) “Türkiye’de Enflasyon Ve İşsizlik Arasındaki İlişki: Zaman Serileri Analizi”, KSÜ Sosyal Bilimler Dergisi, 13(1): 241-262.
- Keten, N.D. (2017) “G8 Ülkelerinde İşsizliğin Enflasyon Üzerindeki Etkilerinin Panel Veri Analizi Yöntemi İle İncelenmesi”, I. Uluslararası Ekonomi, Finans ve Ekonometri Öğrenci Sempozyumu (EFEOS), Tam Metin Bildiri Kitabı, 36-44.
- Kılıç, F. ve Torun, M. (2018) “Bireysel Kredilerin Enflasyon Üzerindeki Etkisi: Türkiye Örneği”, Yönetim ve Ekonomi Araştırmaları Dergisi, 16(1): 18-40.
- Krugman, P., Cooper, R.N. ve Srinivasan, T. N. (1995) “Growing World Trade: Causes and Consequences”, Brookings Papers on Economic Activity, 1: 327-377.
- Köse, Z. (2016) “Türkiye Ekonomisinde 2003-2014 Döneminde Ekonomik Büyüme İşsizlik ve Enflasyon İlişkisi”, Türk Sosyal Bilimler Araştırmaları Dergisi, 1(1): 58-75.
- Phillips, A.W. (1958) “The Relation between Unemployment and The Rate of Change of Money Wage Rates in The United Kingdom: 1861-1957”, Economica, New Series, 25 (100): 283-299.
- Polat, Ö. ve Uslu, E.E. (2010) “Türkiye İmalat Sanayinde Dış Ticaretin İstihdam Üzerindeki Etkisi”, Gaziantep Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 9(3): 489-504.
- Samuelson, P. A. ve Solow, R. M. (1960) “Analytical aspects of anti-inflation policy”, The American Economic Review. 50(2): 177-194.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Sandalcılar, A.R. (2012) “Türkiye’de Yabancı Doğrudan Yatırımların İstihdama Etkisi: Zaman Serisi Analizi”, Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, 26(3-4): 273-285.

Sandalcılar, A.R. ve Yalman, İ. (2012) “Türkiye’de Dış Ticaretteki Serbestleşmenin İşgücü Piyasaları Üzerindeki Etkileri”, Eskişehir Osmangazi Üniversitesi İİBF Dergisi, 7(2): 49-65.

Ulusoy, A. ve Dibo, M. (2016) “Çorum’da İşsizlik ve Enflasyon İlişkisinin Analizi”, Uluslararası Bütün Yönleriyle Çorum Sempozyumu, 28 - 30 Nisan, Bildiriler Kitabı, 89-97.

Uysal, D. ve Erdoğan, S. (2004) “Enflasyon İle İşsizlik Oranı Arasındaki İlişki Ve Türkiye Örneği (1980-2002)”, SÜ İİBF Sosyal ve Ekonomik Araştırmalar Dergisi. 1(6): 35-47.

Valadkhani, A. (2003) “The causes of unemployment in Iran: An empirical investigation”, International Journal of Applied Business and Economic Research, 1(1): 21-33.

Yıldırım K., Karaman D. ve Taşdemir, M. (2008). Makro Ekonomi. 7. Basım, Seçkin Yayıncılık, Ankara.



**TURİZMDE ÖRGÜTSEL DAVRANIŞ ÇALIŞMALARI: ADIM ÜNİVERSİTELERİ'NDE
TAMAMLANAN LİSANSÜSTÜ TEZLER ÜZERİNE BİBLİYOMETRİK BİR ARAŞTIRMA**

Doç. Dr. Işıl ARIKAN SALTIK*

Çağla ALİMANOĞLU**

ÖZET

Multidispliner bir yapıya sahip olan turizmde, emek yoğun bir hizmet sektörü olması ve çalışanların tutum ve davranışlarının hizmet kalitesi ve dolayısıyla müşteri memnuniyeti üzerinde etkili olması nedeniyle örgütsel davranış konuları önem taşımaktadır. Bu çalışmada turizmde örgütsel davranış alanında yazılmış lisansüstü tezlerin bibliyometrik analiz yöntemiyle incelenmesi amaçlanmaktadır. Araştırmanın evrenini ADIM Üniversiteleri'ne bağlı birimlerde turizmde örgütsel davranış konularında yazılmış lisansüstü tezler oluşturmaktadır. Araştırma, 1995 ile 2017 yılları arasında yazılmış lisansüstü tezleri kapsamaktadır. Araştırmanın amacı doğrultusunda, Yükseköğretim Kurulu Başkanlığı Ulusal Tez Merkezi'nde yer alan lisansüstü tezler taranarak araştırma verileri elde edilmiştir. Araştırma kapsamında 137 tanesi yüksek lisans, 29 tanesi doktora düzeyinde olmak üzere toplam 166 lisansüstü tez değerlendirilmiştir. Lisansüstü tezler, tezin tamamlandığı "yıl", "üniversite", "araştırma yöntemi", "sayfa sayısı" ve "tez danışmanın ünvanı" olarak belirlenen kriterler üzerinden ele alınarak, her bir kriter için yüksek lisans ve doktora düzeylerinde incelenmiştir. Araştırma sonucunda, en fazla tezin 2016 yılında yazıldığı belirlenmiştir. Toplam tez sayısı açısından değerlendirildiğinde, en fazla tez yazılan üniversitelerin sırasıyla Adnan Menderes Üniversitesi, Balıkesir Üniversitesi ve Afyon Kocatepe Üniversitesi olduğu görülmüştür. Araştırma yöntemi açısından incelendiğinde tezlerin çoğunun nicel yöntemlerle gerçekleştirildiği tespit edilmiştir. Tezlerin sayfa sayıları 79 ile 439 arasında değişmekte olup, ortalama sayfa sayısı yüksek lisans tezleri için 141, doktora tezleri için 244 olarak hesaplanmıştır. Yüksek lisans tezlerine en fazla Yardımcı Doçent ünvanına, doktora tezlerine ise Profesör ünvanına sahip öğretim üyelerinin danışmanlık yaptığı belirlenmiştir.

Anahtar Kelimeler: *Turizm, Örgütsel Davranış, Lisansüstü Tez, Bibliyometrik Analiz*

Jel Kodları: *D23, I21, L83*

* Muğla Sıtkı Koçman Üniversitesi, Turizm Fakültesi, Kötekli Yerleşkesi, Muğla. isilas@mu.edu.tr ORCID No: 0000-0002-3456-2787. Sorumlu Yazar.

** Adnan Menderes Üniversitesi, Turizm İşletmeciliği ABD, Doktora Öğrencisi, Kuşadası, Aydın. chaglalimanoglu@hotmail.com ORCID No: 0000-0003-3877-7635

**ORGANIZATIONAL BEHAVIOR STUDIES IN TOURISM: A BIBLIOMETRIC RESEARCH
ABOUT POSTGRADUATE THESES IN ADIM UNIVERSITIES**

ABSTRACT

In the tourism sector which has a multidisciplinary structure, organizational behavior issues are important because it is a labor-intensive service sector and the attitudes and behaviors of employees have an effect on service quality and hence customer satisfaction. In this study, it is aimed to examine the postgraduate theses and dissertations written in the field of organizational behavior and tourism by bibliometric analysis method. The universe of the research consists of master theses and doctoral dissertations on organizational behavior in tourism completed in units affiliated to ADIM Universities. The data were obtained by reviewing the postgraduate theses in the Council of Higher Education the National Thesis Center. A total of 165 postgraduate theses were evaluated, 137 of which were master theses and 28 of which were dissertations. Postgraduate theses are taken into consideration in the "year", "university", "methodology", "page number" of thesis and the "title of supervisor". As a result of the research, it was determined that the highest number of thesis was written in 2016. In terms of total number of theses, it was seen that the highest amount of thesis were written in Adnan Menderes University, Balıkesir University and Afyon Kocatepe University, respectively. The number of pages ranged from 79 to 439, and the average number of pages was 141 for master's theses and 247 for doctoral dissertations. It was also determined that supervisors of the most of the master theses were Assistant Professor, while the most of the doctoral dissertations were supervised by Professor Doctors. When examined in terms of research method, it was determined that most of the theses were carried out by quantitative methods.

Keywords: *Tourism, Organizational Behavior, Thesis, Dissertations, Bibliometric Analysis.*

JEL Codes: *D23, I21, L83.*

1.GİRİŞ

Turizm, doğrudan ya da dolaylı olarak kendine ait özellikleri kapsayan birçok bilim dalı ile etkileşim halindedir. İnsan gereksinimlerinin karşılanmasına dayalı bir alan olarak turizmin diğer bilim dalları ve disiplinler ile ilişkili olması kaçınılmazdır (Kozak, 2011). Turizm, multidisipliner ve disiplinler arası bir faaliyettir. Bunun yanı sıra, disiplinler arası etkinlikler de, turizm alanında faaliyet göstermektedir. Bu bağlamda, turizmin diğer disiplinlerden ayrılmaz ve bütünlük bir yapıda olduğu

söylenmektedir (Xiao vd., 2011; Tribe, 1997). Turizm sektörü yılın 365 günü 24 saat hizmet veren ve üretimle üretilen ürünün sunumunun eşzamanlı olarak gerçekleştiği bir faaliyet olarak büyük ölçüde insan gücüne dayalı olan emek-yoğun bir sektördür. Turizmde hizmeti üreten, sunan ve hizmet kalitesinin asli belirleyeni yine insan olmaktadır (İçöz vd., 2007).

Sürekli değişim ve gelişim içinde olan günümüz modern çağında artan rekabet ve beraberindeki teknolojik gelişmeler işletmeleri bu değişime uyum sağlamaya götürmektedir. Bu değişim özellikle de turizm gibi hizmet sektöründeki işletmelerde insan kaynağının önemini arttırmıştır. Örgüt içi etkinlik, örgütlerin metasal kaynaklarının çokluğundan ziyade, insan kaynağının niteliğine bağlıdır (Sezgin, 2005). Dolayısıyla, bir hizmet sektörü olan turizmde işgören davranışlarını inceleyen örgütsel davranış konusu yönetsel anlamda önemli bir konu niteliğindedir. Bu çalışmanın amacı, ADIM Üniversitelerinde turizmde örgütsel davranış alanında gerçekleştirilen yüksek lisans ve doktora tezlerini inceleyerek, konuyu ele alan lisansüstü tezlerin genel durumunu bibliyometrik olarak analiz etmektir. Çalışma, turizmde örgütsel davranış konusunun çalışılma yoğunluğunu ve dağılımını ortaya koyacak olması ve geçmişe dönük bütünsel bir değerlendirme sunacak olması nedeniyle önem taşımaktadır.

2.KAVRAMSAL ÇERÇEVE

2.1.Bir Disiplin Olarak Turizm

Uluslararası turizm sözlüğünde turizm; “zevk için yapılan geziler ve seyahatleri yapmak için gerçekleştirilen insan faaliyetlerinin tümü” şeklinde açıklanmaktadır. Turizm olayına farklı yönlerden değinen yazarlar, çeşitli tanımlamalar yapmışlardır. Turizm terimi 1980’li yıllarda AIEST (Uluslararası Bilimsel Turizm Uzmanları Birliği) tarafından yeniden düzenlenmiştir. Bu düzenleme kapsamında turizm; “insanların devamlı ikamet ettikleri, çalıştıkları ve her zamanki olağan ihtiyaçlarını karşıladıkları yerlerin dışına seyahatleri ve buralardaki, genellikle turizm işletmelerinin ürettiği mal ve hizmetleri talep ederek, geçici konaklamalarından doğan olaylar ve ilişkiler bütünü” olarak tanımlanmıştır (Akt. Kozak vd., 2011: 1-5).

Turizm multidisipliner bir araştırma topluluğudur. Özellikle, beşeri bilimler (psikoloji, davranış bilimleri, yönetim ve organizasyon), sosyokültürel araştırmalar, (sosyoloji, antropoloji), ekonomi (ekonometri, istatistik, talep modelleme ve tahmin), coğrafya (çevre planlama ve geliştirme) ve diğer sosyal bilimler turizmle ilişkilendirilebilecek alanlar arasında yer almaktadır. Başka bir deyişle multidisipliner yapısı nedeniyle turizm; psikoloji, sosyoloji, sosyal psikoloji, işletme, ekonomi, tarih, coğrafya ve antropoloji gibi birçok disiplinden etkilenmektedir (Jafari ve Ritchie, 1981; Graburn ve Jafari, 1991; Veal, 1997).

90'lı yıllarda turizm ile ilgili araştırılan konular bazında en fazla odaklanılan konular; turizm pazarlaması, rekreasyon, inanç turizmi, turizm coğrafyası, muhasebe-finansman, turizm ekonomisi gibi konular iken, 2000'li yıllara gelindiğinde bu konulara, örgütsel davranış, yönetim ve organizasyon, tüketici davranışları ve insan kaynakları gibi konular da eklenmiştir. 2005 yılından günümüze kadar olan yıllar arasında ise, özellikle örgütsel davranış ile ilgili konuların en çok odaklanılan konulardan birisi olduğu belirtilmektedir (Tekin, 2016: 179-183).

2.2.Lisansüstü Eğitim ve ADIM Üniversiteleri

Lisansüstü eğitim, akademik yaşantı açısından ülkenin ihtiyaç duyduğu nitelikli akademisyenler yetiştirmede, bilgi ve teknoloji üretimine dayalı nitelikli araştırmaların yapılmasında ve ülkenin toplumsal, ekonomik, bilimsel, sosyo-kültürel ve teknolojik açıdan gelişmesinde önemli rol oynamaktadır (Dilci ve Gürol, 2012: 1074; Karakütük, 1989: 506). Turizmin akademik hayata girmesiyle, turizm alanının gelişmesi için yapılan araştırma ve ortaya çıkan yayınların öneminin de büyük ölçüde arttığı gözlemlenmektedir (Jogaratham vd., 2005: 641).

Türkiye'de lisansüstü eğitim; 1970-1982 yılları arasında Amerika Birleşik Devletleri'nin sistemi model alınarak yapılandırılmıştır. Yüksek lisans ve doktora olarak iki ayrı düzeyde sınıflandırılan lisansüstü eğitim kapsamında ayrıca tez hazırlama ve sunulması koşulu yer almaktadır (Bozan, 2012: 178). Lisansüstü eğitimin Türkiye'deki gelişimine bakıldığında, 2017 yılı itibarıyla, Türkiye'de 107 üniversite lisansüstü düzey eğitim verildiği görülmektedir (Ayrıntılı bilgi için bakınız: www.yok.gov.tr). Lisansüstü eğitim; bağımlılık ve adli bilimler, bilişim teknolojileri, eğitim bilimleri, fen bilimleri, güzel sanatlar, işletme, mühendislik ve fen bilimleri, sağlık bilimleri, sosyal bilimler enstitüsü gibi çeşitli üniversitelerde farklı enstitü çatısı altında verilmektedir.

Araştırmaya konu olan ADIM Üniversiteleri (detaylı bilgi için bakınız: <http://www.adim.org.tr/>) kapsamında 14 üniversite yer almaktadır. Akdeniz, Ege ve İç Anadolu bölgelerinde yer alan 13 devlet ve 1 vakıf üniversitesi ADIM Üniversitesi olarak nitelendirilmektedir. Bu üniversiteler alfabetik olarak Antalya Bilim Üniversitesi (ABÜ), Adnan Menderes Üniversitesi (ADÜ), Afyon Kocatepe Üniversitesi (AKÜ), Balıkesir Üniversitesi (BAÜ), Bilecik Şeyh Edebali Üniversitesi (BŞEÜ), Celal Bayar Üniversitesi (CBÜ), Çanakkale On Sekiz Mart Üniversitesi (ÇOMÜ), Dumlupınar Üniversitesi (DÜ), Eskişehir Osmangazi Üniversitesi (ESOÜ), Mehmet Akif Ersoy Üniversitesi (MAKÜ), Muğla Sıtkı Koçman Üniversitesi (MSKÜ), Pamukkale Üniversitesi (PAÜ), Süleyman Demirel Üniversitesi (SDÜ) ve Uşak Üniversitesi (UÜ) şeklinde sıralanmaktadır. ADIM Üniversiteleri'nin tamamında en az iki enstitü bünyesinde ve farklı programlarda lisansüstü düzeyde eğitim verilmektedir.

2.3.Bibliyometrik Analiz

Belirli bir alanda literatüre katkı sağlamak ve ileride yapılacak olan araştırmalar için araştırmacılara yol gösterici olmak açısından pek çok alanda bibliyometri tekniğinden faydalanılmaktadır (Aydın, 2014: 56). Bir bilim dalıyla ilgili literatürün profilini ortaya koyan bibliyometrik çalışmalar, bilimsel yayınların tanımlanması, sınıflandırılması, kaynakçalarının ayrıntılı olarak ele alınması ve nitel yöntemle analiz edilmesi ile ilgili olarak bilgi vermekte ve bu sayede üzerinde çalışılan bilim dalına yazılı kaynaklar halinde katkıda bulunmaktadır (Koç, 2004; Al ve Soydal, 2010: 350).

Ulusal ve uluslararası olmak üzere, literatüre katkı amaçlı yapılmış, tezleri bibliyometrik özellikler bakımından inceleyen çalışmalar mevcuttur. Turizm araştırmalarında bibliyometri genellikle dergi ve makalelerin incelenerek değerlendirilmesi şeklinde yapılmaktadır (Hall, 2011). Son yıllarda turizm alanında yapılan bibliyometrik çalışmalarda yoğun bir artış görülmektedir (Kozak, 1995; İçöz ve Kozak, 1999; Özel ve Kozak, 2012; 2012; Evren ve Kozak, 2013; Karagöz ve Kozak, 2014; Cevizkaya, Avcıkurt, İlsay, 2014; Turan, 2014; Aydın, 2014; Nergiz, 2014; Kaya, 2014; Türktarhan, 2014; Şahin ve Acun, 2015; Tayfun vd., 2016; Arslan ve Emeksiz, 2016; Turgut ve Beğenirbaş, 2016; Bozok vd., 2017; Alımanoğlu ve Ayazlar, 2017).

Turizm alanında gerçekleştirilecek bibliyometrik çalışmaların artarak devam etmesi, turizmin çeşitli alanlarında bilgi ve fikir sahibi olmak ve ilgili alanlara daha geniş bir bakış açısıyla bakabilmek adına fayda sağlayacaktır (Özel ve Kozak, 2012). Bu bağlamda, bu çalışma ile ileride yapılacak olan örgütsel davranış ve turizm konulu lisansüstü tez çalışmalarına ve beraberinde turizmde örgütsel davranış alanına katkı sağlanması beklenmektedir.

3.YÖNTEM

Araştırmanın amacı, turizmde örgütsel davranış alanında yazılmış lisansüstü tezlerin bibliyometrik analiz yöntemiyle incelenmesidir. Böylelikle multidisipliner bir yapıya sahip olan turizmde örgütsel davranış konusunun lisansüstü tezler düzeyinde ele alınma durumunun belirlenmesi ve bu konuda çalışma isteğinde olan araştırmacılara yol gösterici bulgular sunulması öngörülmektedir.

Araştırmanın evrenini ADİM Üniversiteleri'ne bağlı birimlerde turizmde örgütsel davranış konularında yazılmış lisansüstü tezler oluşturmaktadır. Araştırma evreni ulaşılabilir olması özelliği nedeniyle sınırlı niteliktedir. Bu nedenle evrenin tamamına ulaşılması hedeflenmiştir. Araştırmanın amacı doğrultusunda, Yükseköğretim Kurulu Başkanlığı Ulusal Tez Merkezi'nde yer alan lisansüstü tezlerin ilgili veri tabanından taranması suretiyle araştırma verileri elde edilmiştir.

Araştırma, belirtilen kapsamda yazılmış ilk yüksek lisans tezinin tamamlanma tarihi olan 1995 ile 2017 yılları arasında yazılmış lisansüstü tezleri kapsamaktadır. Araştırma kapsamında 137 tanesi

yüksek lisans, 29 tanesi doktora düzeyinde olmak üzere turizmde örgütsel davranış alanında yazılmış toplam 166 lisansüstü tez belirlenmiştir. Lisansüstü tezlerin bibliyometrik analizinde, tezin tamamlandığı “yıl”, “üniversite”, “anabilim dalı”, “yöntemi”, “sayfa sayısı” ve “tez danışmanın ünvanı” kriter olarak belirlenerek analizler gerçekleştirilmiştir.

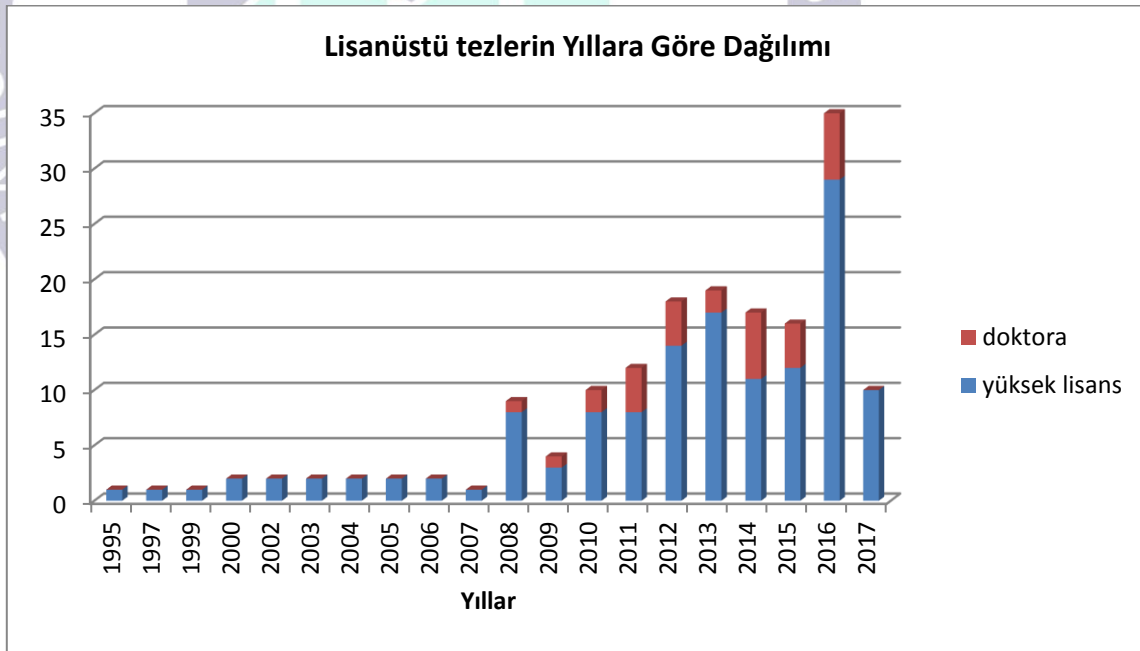
4.BULGULAR

Araştırma yönteminde belirtilen her bir kriter için, yüksek lisans ve doktora düzeylerinde gerçekleştirilen bibliyometrik analiz sonucunda edinilen bulgular bu bölümde sunulmaktadır.

4.1.Lisansüstü Tezlerin Yıllara Göre Dağılımı

ADIM Üniversiteleri’nde turizmde örgütsel davranış alanında yazılan lisansüstü tezler incelendiğinde, ilk tezin 1995 yılında tamamlanan bir yüksek lisans tezi olduğu bilgisine ulaşılmıştır. Toplam 23 yıllık bir dönemi kapsayan bu araştırmada araştırma evreni olarak belirlenen tezlerin %83’ünü yüksek lisans tezlerinin, %17’sini doktora tezlerinin oluşturduğu belirlenmiştir. Şekil 1’de Lisansüstü Tezlerin Yıllara Göre Dağılımı sunulmaktadır.

Şekil 1. Lisansüstü Tezlerin Yıllara Göre Dağılımı



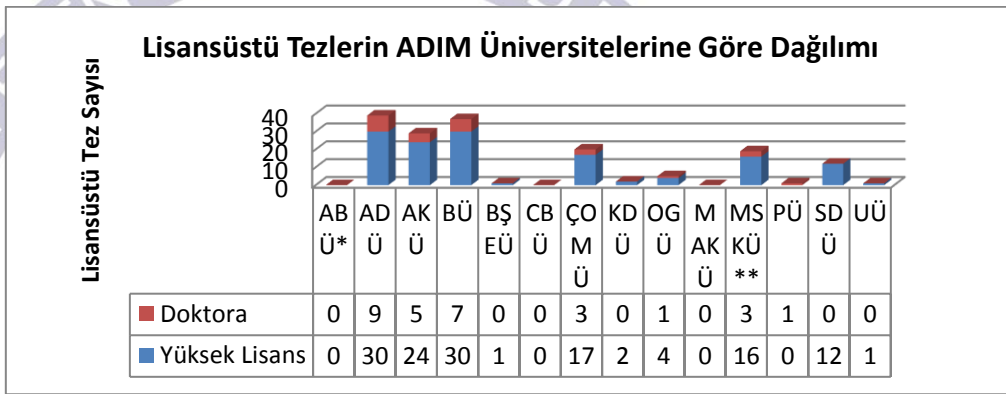
Araştırma sonucunda, en fazla yüksek lisans tezinin (N=29) 2016 yılında, en fazla doktora tezinin (N=6) ise 2014 ve 2016 yazıldığı belirlenmiştir. ADIM Üniversitelerinde turizmde örgütsel davranış alanında ilk doktora tezi 2008 yılında yazılmıştır. 1996, 1998 ve 2001 yıllarında bu alanda tamamlanan

lisansüstü tezin bulunmadığı görülmüştür. 1995 ile 2007 yılları arasında ve 2017 yılında ise yalnızca yüksek lisans tezlerinin yazıldığı doktora tezinin olmadığı belirlenmiştir.

4.2.Lisansüstü Tezlerin Üniversitelere Göre Dağılımı

Lisansüstü tezlerin ADIM üniversitelerine göre dağılımı incelendiğinde; en fazla tez yazılan üniversitelerin sırasıyla Adnan Menderes Üniversitesi (N=39), Balıkesir Üniversitesi (N=37) ve Afyon Kocatepe Üniversitesi (N=29) olduğu görülmüştür. Lisansüstü Tezlerin Üniversitelere Göre Dağılımı Şekil 2’de sunulmaktadır.

Şekil 2. Lisansüstü Tezlerin ADIM Üniversitelerine Göre Dağılımı

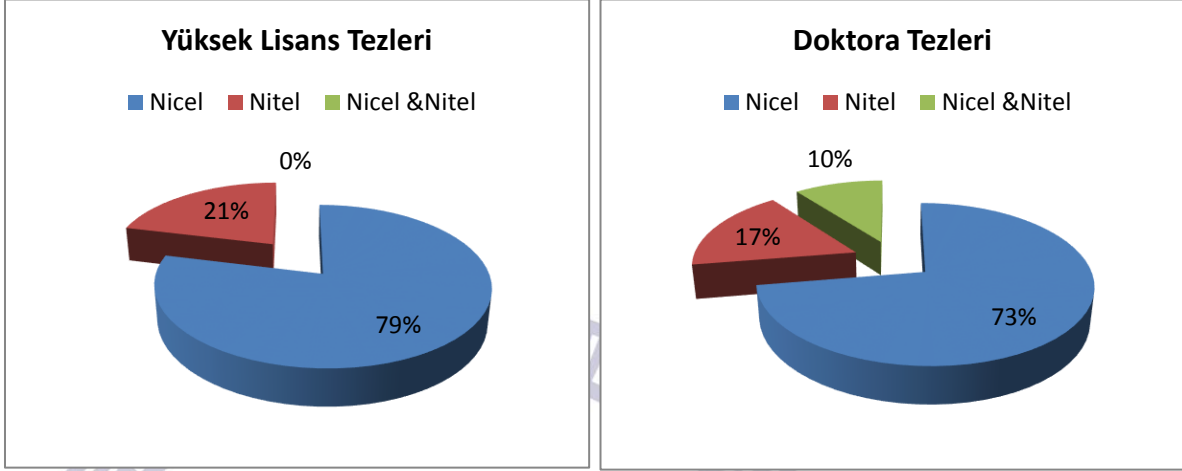


Yüksek lisans düzeyindeki tezler incelendiğinde en fazla sayıda tezin (N=30); Adnan Menderes Üniversitesi ve Balıkesir Üniversitesi’nde tamamlandığı görülmüştür. Antalya Bilim Üniversitesi, Celal Bayar Üniversitesi ve Mehmet Akif Ersoy Üniversitesi çatısında araştırmada incelenen kapsamda yazılmış bir lisansüstü tez belirlenmemiştir. Bilecik Üniversitesi ve Uşak Üniversitesi’nde ise yalnızca birer adet lisansüstü tez yazıldığı görülmüştür. Doktora düzeyindeki lisansüstü tezler değerlendirildiğinde; sadece yedi ADIM üniversitesinde bu alanda yazılmış tezin bulunduğu ve en fazla sayıda tezin (N=9) Adnan Menderes Üniversitesi’nde yazıldığı, bunu sırasıyla Balıkesir Üniversitesi (N=7) ve Afyon Kocatepe Üniversitesi’nin (N=5) izlediği belirlenmiştir.

4.3.Lisansüstü Tezlerin Araştırma Yöntemlerine Göre Dağılımı

Araştırma yöntemi açısından incelendiğinde lisansüstü tezlerin ağırlıklı olarak nicel yöntemlerle (N=129) gerçekleştirildiği tespit edilmiştir. Nitel yöntemlerle gerçekleştirilen toplam 34 adet lisansüstü tez olduğu, buna karşın nicel ve nitel yöntemleri birlikte kullanan sadece 3 adet tez olduğu belirlenmiştir. Yüksek lisans ve doktora düzeylerinde yazılan tezlerin uyguladıkları araştırma yöntemlerine göre dağılımı Şekil 5’te gösterilmektedir.

Şekil 5. Yüksek Lisans ve Doktora Tezlerinin Araştırma Yöntemlerine Göre Dağılımı



Yüksek lisans düzeyinde yazılan tezlerin %79'u (N=108) nicel araştırma yöntemleriyle, %21'i nitel araştırma yöntemleriyle gerçekleştirildiği, buna karşın her iki yöntemin bir arada kullanıldığı bir tezin olmadığı belirlenmiştir. Doktora tezlerinde de en fazla nicel araştırma yöntemlerinin tercih edildiği (N=21), bununla birlikte nitel ve nicel araştırma yöntemlerinin birlikte uygulandığı (N=3) tezlerin de olduğu görülmüştür.

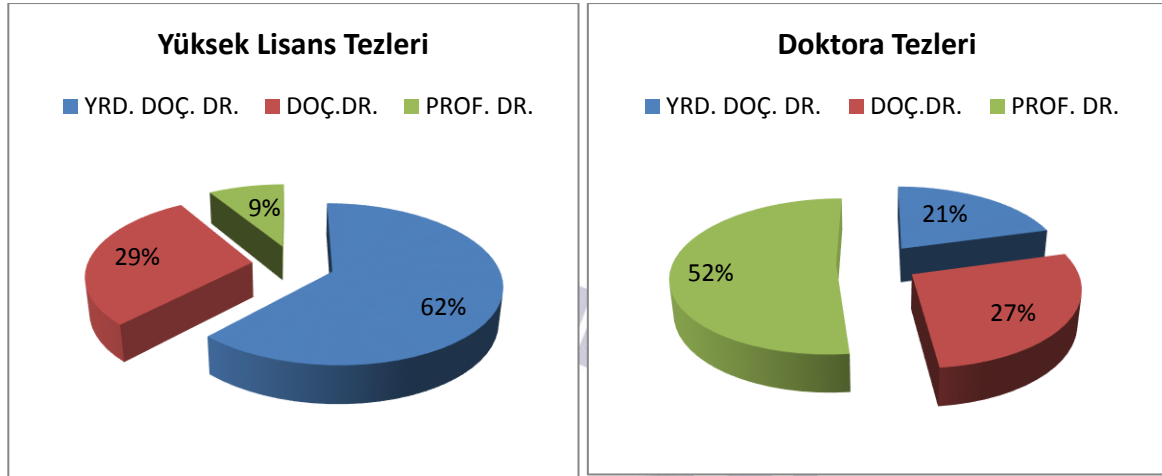
4.4.Lisansüstü Tezlerin Sayfa Sayılarına Göre Dağılımı

Lisansüstü tezlerin sayfa sayılarının değerlendirilmesinde, Yükseköğretim Kurulu Başkanlığı Ulusal Tez Merkezi tarama sayfasında yer alan ve tez künyesi başlığı altında belirtilen sayfa sayısı dikkate alınmıştır. Lisansüstü tezlerin sayfa sayıları 79 ile 439 arasında değişmekte olup ortalama sayfa sayısı 159 olarak hesaplanmıştır. En az sayfa sayısına sahip olan yüksek lisans tezinin 79 sayfa, en fazla sayfa sayısına sahip olan yüksek lisans tezinin ise 271 sayfa olduğu belirlenmiştir. Ortalama sayfa sayısı yüksek lisans tezleri için 141 olarak hesaplanmıştır. Doktora tezlerine bakıldığında en kısa tezin 114 sayfadan, en uzun tezin ise 439 sayfadan oluştuğu görülmüştür. Doktora tezleri için ortalama sayfa sayısı 244 olarak hesaplanmıştır.

4.5.Lisansüstü Tezlerin Danışman Ünvanına Göre Dağılımı

Lisansüstü tezlere danışmanlık yapan öğretim üyelerinin ünvanlarına göre yapılan incelemede, ağırlıklı olarak Yardımcı Doçent ünvanındaki öğretim üyelerinin (N=91) danışmanlık görevini yürüttüğü, yardımcı doçentleri sırasıyla Doçent ünvanındaki (N=48) ve Profesör ünvanındaki (N=27) öğretim üyelerinin takip ettiği görülmüştür. Yüksek lisans ve doktora düzeylerinde yazılan tezlerin danışman ünvanına göre dağılımı Şekil 7'de gösterilmektedir.

Şekil 7. Lisansüstü Tezlerin Danışman Ünvanına Göre Dağılımı



Danışmanların lisansüstü düzeylere göre dağılımı incelendiğinde, yüksek lisans tezlerinde danışmanlık dağılımının genel dağılımla uyumlu bir yapıda olduğu belirlenmiştir. Yüksek lisans düzeyinde yazılan tezlerin %62'si (N=85) Yardımcı Doçentlerin, %29'u (N=40) Doçentlerin, %9'u (N=12) ise Profesörlerin danışmanlığında tamamlanmıştır. Doktora düzeyinde yazılan tezler danışman ünvanları açısından değerlendirildiğinde ise sıralamanın tam tersinde olduğu görülmüştür. Doktora tezlerinin yarısından fazlasına (N=15) Profesör ünvanına sahip öğretim üyelerinin danışmanlık yaptığı, profesörleri sırasıyla Doçentlerin (N=8) ve Yardımcı Doçentlerin (N=6) takip ettiği belirlenmiştir.

5.SONUÇ VE TARTIŞMA

Bu araştırmada, ADIM üniversiteleri bünyesinde 1995 ile 2017 yılları arasında turizmde örgütsel davranış konusunda tamamlanmış olan lisansüstü tezler bibliyometrik olarak incelenmiştir.

Araştırma sonucunda, lisansüstü tezlerin ağırlıklı olarak yüksek lisans düzeyinde olduğu, doktora düzeyindeki tezlerin ise daha düşük sayıda olduğu belirlenmiş; turizmde örgütsel davranış konusunda yazılan lisansüstü tezlerin sayısının son on yılda arttığı görülmüştür. Bu artış 1990-2013 yılları arasında Türkiye'deki lisansüstü turizm tezlerinin bibliyometrik profilini belirlediği çalışma ile uyum göstermektedir (Nergiz, 2014).

Araştırma konusunda en fazla tez yazılan üniversiteler Adnan Menderes Üniversitesi ve Balıkesir Üniversitesi olarak belirlenmiştir. Her iki üniversitenin lisansüstü eğitim programları incelendiğinde, turizm alanındaki yüksek lisans ve doktora eğitimini en uzun süredir yürüten iki üniversite olduğu belirlenmiştir. Lisansüstü tezlerin hazırlanması, öğrenci ve danışmanın işbirliği ile birlikte

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

gerçekleşmekte ve uzun bir dönemi kapsamaktadır. Bu süreçte, hem lisansüstü eğitim konusundaki kurumsal tecrübe hem de danışman öğretim üyesinin bireysel tecrübesi, önemli bir etken olabilmektedir. Dolayısıyla bu sonuç kurumların tarihsel gelişimi ile uyum göstermektedir.

Lisansüstü tezlere, en fazla danışmanlığın yüksek lisans tezlerine yardımcı doçentler tarafından yapılmasının esas olarak yardımcı doçent ünvanına sahip olan öğretim üyesinin daha fazla sayıda olmasından kaynaklandığı düşünülmektedir. Doktora tezlerine ağırlıklı olarak profesörlerin danışmanlık yapmasında ise iki husus etkili olabilir. Bunlardan birincisi, doktora düzeyinde danışmanlık yapabilmek için bazı önkoşulların yerine getirilme zorunluluğu nedeniyle yardımcı doçentlerin doktora düzeyinde daha az sayıda danışmanlık yapabiliyor olmalarıdır. İkincisi ise doktora düzeyinde eğitim veren program ve dolayısıyla eğitim alan öğrenci sayısının daha az olmasıdır.

Lisansüstü tezlerde ağırlıklı olarak nicel araştırma yöntemlerinin kullanıldığı belirlenmiştir. Bununla birlikte sadece doktora düzeyinde de olsa, nicel ve nitel araştırma yöntemlerinin birlikte kullanıldığı çalışmaların da olması, tez çalışmalarının yönetsel olarak gelişimini göstermesi açısından anlamlıdır.

Bu araştırma kapsamında yalnızca ADİM üniversitesi bünyesinde hazırlanan lisansüstü tezler incelenmesi araştırmanın en belirgin sınırlılığıdır. Gelecek araştırmalarda, tüm üniversitelerin araştırma alanında dahil edilerek araştırma evrenin genişletilmesi veya araştırma özetinin kurgusu, kaynakçanın kapsamı gibi farklı kriterlerin de bibliyometrik analize dahil edileceği incelemeler yapılarak bulguların zenginleştirilmesi önerilebilir.

KAYNAKÇA

Adım Üniversiteleri Web Sayfası (t.y.) <http://www.adim.org.tr/> (23.03.2018 tarihinde erişildi)

Al, U., Soydal, İ. ve Yalçın, H. (2010) “Bibliyometrik Özellikleri Açısından Bilig’in Değerlendirilmesi”. *bilig*, 55: 1-20.

Alımanoğlu, Ç. , Ayazlar, G. (2017) “Türkiye’de Kırsal Turizm Konulu Lisansüstü Tez Çalışmaları Üzerine Bibliyometrik Bir İnceleme (2003-2016)”, VI. Ulusal Kırsal Turizm Kongresi, Mayıs 04-06: 2017 – Bursa.

Arslan, E. , Emeksiz M. (2016) “Konaklama İşletmelerinde Çevre Yönetimi Konusunun Bibliyometrik Profili ve Gelecek Çalışmalar İçin Öneriler”, *Disiplinlerarası Akademik Turizm Dergisi*, 2016, 1(1): 1-12.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Aydın, B. (2014). “Yükseköğretim Kurulu Tez Merkezinde (YÖKTEZ) Yiyecek İçecek İşletmeciliği Alanında Kayıtlı Bulunan Tezlerin Bibliyometrik Analizi”, Kozak, Günlü (Ed). VII. Lisansüstü Turizm Öğrencileri Araştırma Kongresi Bildiri Kitabı, 04-05 Nisan 2014, Ankara, 55-70.
- Bozan, M. (2012), “Lisansüstü Eğitimde Nitelik Arayışları”, Sosyal Ve Beşeri Bilimler Dergisi Cilt 4, No 2.
- Bozok, D., Kılıç, S. N., Özdemir, S. S., (2017). “Turizm Literatüründe Kırsal Turizmin Bibliyometrik Analizi”, Journal of Human Sciences, 14(1): 187-202.
- Cevizkaya, G., Avcıkurt, C. ve İlsay, S. (2014). “Turizm Alan Yazınında Engelliler ile ilgili Çalışmaların Bibliyometrik Profili (2000-2013)”, 15. Ulusal Turizm Kongresi, Gazi Üniversitesi, Ankara, 145- 151.
- Çiçek, D., Kozak, N. (2012). “Anatolia: Turizm Araştırmaları Dergisi’nde Yayımlanan Hakem Denetimli Makalelerin Bibliyometrik Profili”, Kozak, Yeşiltaş (Ed). VI. Lisansüstü Turizm Öğrencileri Araştırma Kongresi, Nisan, Kemer, Antalya, 196-211.
- Dilci, T ve Gürol, M. (2012) “Öğretim Üyeleri Bakış Açısıyla Lisansüstü Eğitimin Yaşam Alanına Yansımaları: Eğitim Bilimleri Örnekleme”, Kastamonu Eğitim Dergisi, Cilt 20, Sayı 3, 1073 - 1090.
- Graburn, N. and Jafari, J. (1991) “Tourism Social Science”, Annals of Tourism Research 18: 1-11.
- Evren, S. ve Kozak, N. (2012) “Türkiye’de 2000-2010 Yılları Arasında Yayımlanan Turizm Konulu Makalelerin Bibliyometrik Analizi”, Kozak, Yeşiltaş (Ed). VI. Lisansüstü Turizm Öğrencileri Araştırma Kongresi, Nisan, Kemer, Antalya, 250-266.
- Hall, C. M. (2011) “Publish and Perish? Bibliometric Analysis, Journal Ranking And The Assessment of Research Quality in Tourism”, Tourism Management, 32(1): 16-27.
- İçöz, O., Kozak, N. (1999) “Turizm İşletmeciliği Dergisinin Turizm Literatürüne Katkısı Hakkında Bir İnceleme”, Anatolia: Turizm Araştırmaları Dergisi, 10, Eylül-Aralık, 9-17.
- Jafari, J.,and Ritchie, B. (1981) “Towards a Framework of Tourism Education: Problems and Prospects”, Annals of Tourism Research 8: 13-34.
- Jogaratanam, G., McCleary, K. W, Mena, M. M. ve Eun Yoo, J. J. (2005) “An Analysis of Hospitality and Tourism Research: Institutional Contributions”, Journal of Hospitality & Tourism Research, 29 (3): 356-371.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Karagöz, D., Kozak, N. (2014). "Anatolia Turizm Araştırmaları Dergisi'nin Bibliyometrik Analizi: Araştırma Konuları ve Kurumlar Arası İş Birliğinin Sosyal Ağ Analizi ile İncelenmesi", Türk Kütüphaneciliği, 28(1): 47-61.
- Karakütük, K. (1989) "Türkiye'de Lisansüstü Öğretim, Sorunları ve Çözüm Önerileri", Ankara Üniversitesi Eğitim Bilimleri Fakültesi Dergisi, 505 - 528.
- Kaya, B. (2014) "Annals of Tourism Research Dergisinde 2004-2013 Yılları Arasında Yayımlanan Makalelerin Bibliyometrik Analizi", Kozak, Günlü (Ed). VII. Lisansüstü Turizm Öğrencileri Araştırma Kongresi Bildiri Kitabı, 04-05 Nisan 2014, Ankara, 39-54.
- Koç, M. (2004) "Uludağ Üniversitesi'nde Din Psikolojisi ile İlgili Yapılan Tezler (1980-2002)" Üzerine Bir Araştırma", Sakarya Üniversitesi İlahiyat Fakültesi Dergisi, 9: 43-66.
- Kozak, N. (1995) "Türkiye'de Yayımlanan Turizm Konulu Makaleler Üzerine Bir İnceleme", Anatolia Türk Turizm Yazını Araştırmaları III, Mart.
- Kozak, N. (2001) "Türkiye'de Turizm Pazarlaması Literatürünün Gelişim Süreci: 1972-1998 Yılları Arasında Hazırlanmış Lisansüstü Tez Çalışmaları Üzerine Biyo-Bibliyografik Bir İnceleme", Anatolia Turizm Araştırmaları Dergisi: Bahar, 12: 26-33.
- Kozak, Günlü (Ed) VII. Lisansüstü Turizm Öğrencileri Araştırma Kongresi Bildiri Kitabı, 04-05 Nisan 2014, Ankara, 212-221.
- Kozak, Günlü (Ed) VII. Lisansüstü Turizm Öğrencileri Araştırma Kongresi Bildiri Kitabı, 04-05 Nisan 2014, 3-15.
- Nergiz, H. G. (2014) "Türkiye'de Lisansüstü Turizm Tezlerinin Bibliyometrik Profili (1990- 2013)",
- Özel, Ö. H., Kozak, N. (2012). "Turizm Pazarlaması Alanının Bibliyometrik Profili (2000- 2010) ve Bir Atıf Analizi Çalışması", Türk Kütüphaneciliği, 26(4): 715-733.
- Sezgin, F. (2005). "Örgütsel Vatandaşlık Davranışları: Kavramsal Bir Çözümleme ve Okul Açısından Bazı Çıkarımlar", Gazi Eğitim Fakültesi Dergisi, 25(1): 317-339.
- Şahin, Ş., Acun, A. (2015). "Turist Rehberliği Alanının Bibliyometrik Profili (Makaleler ve Lisansüstü Tezler)", 16. Ulusal Turizm Kongresi, Çanakkale.
- Tayfun, A., Küçükergin, F., Aysen, E., Eren, A., Özekici, Y. K. (2016). "Turizm Alanında Yazılan Lisansüstü Tezlere Yönelik Bibliyometrik Bir Analiz", Gazi Üniversitesi Turizm Fakültesi Dergisi, 1, 50-69.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Tekin, A. Ö. (2016). "Türkiye'deki Lisansüstü Turizm Tezlerinde Odaklanılan Konular: 1984-2015", Uluslararası Alanya İşletme Fakültesi Dergisi International Journal of Alanya Faculty of Business Yıl:2016, C:8, S:2, 175-187.
- Tribe, J. (1997). "The Indiscipline of Tourism", Annals of Tourism Research, 24(3): 638-657.
- Turan, A. (2014). "Turizm Konulu Yüksek Lisans Tezlerinin Bibliyometrik Özellikleri (1984 2013)",
- Turgut, E., Beğenirbaş M. (2016). "Türkiye'deki Örgütsel Davranış Yazınına Bakış: Örgütsel Davranış Kongrelerinin Yazar ve İçerik Yönünden Ağ Analizi ile İncelenmesi", Gazi Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi 18/1, 328-354.
- Türktarhan, G. (2014). "Türkiye'de Turizm Alan yazınının İncelenmesi: "Sistematik Türkiye Turizm İşletmeciliği Bibliyografyası (1929- 1984)" Üzerine Bir İnceleme", Kozak, Günlü (Ed). VII. Lisansüstü Turizm Öğrencileri Araştırma Kongresi Bildiri Kitabı, 04-05 Nisan 2014, Ankara, 183-199.
- Veal, J. A. (1997). "Research Methods for Leisure and Tourism: A Practical Guide", Pitman Institute of Leisure and Amenity Management, 15-33.
- Yüksek Öğretim Kurulu (YÖK) Web Sıtfası. (t.y.) <http://www.yok.gov.tr/web/guest/universitelerimiz> (23.03.2018 tarihinde erişildi)
- Xiao, H., ve Smith, S. L. J. (2011). "The Making of Tourism Research Insights From A Social Sciences Journal", Annals of Tourism Research, 33(2): 490-507.

Extended With
Social Sciences

**ENFLASYON VE İKTİSADİ BÜYÜMENİN KREDİ RİSK PRİMİ (CDS) ÜZERİNDEKİ
ETKİSİ: BRICS ÜLKELERİ VE TÜRKİYE ÖRNEĞİ**

Mustafa KIRCA*

Fusun ÇELEBİ BOZ**

Ümit YILDIZ***

ÖZET

Bu çalışmada BRICS+T (Brezilya, Rusya, Hindistan, Çin, Güney Afrika ve Türkiye) ülkeleri için 2015M12-2018M06 dönemi için aylık sanayi üretim endeksi (IPI) ile enflasyon (CPI) değişkenlerinin kredi risk swapı (CDS) üzerindeki etkilerinin araştırılması amaçlanmıştır. Bu amaç doğrultusunda ilk olarak değişkenlerin durağanlık düzeyleri Smith vd. (2004) tarafından geliştirilen bootstrap birim kök testi kullanılarak belirlenmiş ve değişkenlerin birinci farklarında durağan oldukları tespit edilmiştir. Sonrasında Westerlund ve Edgerton (2007) tarafından geliştirilen panel bootstrap eşbütünleşme testi ile değişkenler arasında uzun dönemli ilişkilerin olduğu bulgusuna ulaşılmıştır. Son aşamada ise Pesaran ve Smith (1995) tarafından geliştirilen katsayı tahmin yöntemi ile IPI'nin ve CPI'in CDS üzerindeki etkileri tahmin edilmiştir. Buna göre panelin tamamı için CPI'in CDS üzerine anlamlı bir etkisi varken, IPI'nin etkisi anlamsızdır. CPI'de meydana gelen 1 birimlik artış CDS'i 14 birim artırmaktadır. Ancak bu anlamlı ve anlamsız ilişkiler ülkeden ülkeye göre değişmektedir. Bunun sebebi ise modelin heterojen bir yapıda olmasıdır. Bu bağlamda IPI'de meydana gelen artışların CDS'i etkilediği ülkeler Çin, Hindistan, Türkiye ve Güney Afrika'dır. Güney Afrika hariç bu ülkelerde IPI'deki artış CDS'i negatif etkilemektedir. CPI'de meydana gelen artışların CDS'i etkilediği ülkeler ise Brezilya, Hindistan, Rusya ve Güney Afrika'dır. Hindistan hariç diğer ülkelerde CPI'de meydana gelen artış CDS'i pozitif etkilemektedir.

Anahtar Kelimeler: CDS, Enflasyon, İktisadi Büyüme, Panel Eşbütünleşme Testi, BRICS

Jel Kodları: G15, O40,E44

* Düzce Üniversitesi, Akçakoca Bey Siyasal Bilgiler Fakültesi, İktisat Bölümü, Akçakoca, Düzce, Türkiye, mustafakirca52@gmail.com

** Bayburt Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, Merkez, Bayburt, Türkiye, fcelebi@bayburt.edu.tr

*** Bayburt Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi İktisat Bölümü, Merkez, Bayburt, Türkiye, umityildiz@bayburt.edu.tr

**THE EFFECTS OF INFLATION AND ECONOMIC GROWTH ON CREDIT DEFAULT
SWAP (CDS): THE CASE OF BRICS COUNTRIES AND TURKEY**

ABSTRACT

In this study, it is aim to investigate the effects of industrial production index (IPI) and inflation (CPI) variables on Credit Default Swap (CDS) for BRICS + T (Brasil, Russia, India, China, South Africa and Turkey) countries for the period of 2015M12-2018M06. For this purpose, firstly, the stationary of variables is investiagated by using the bootstrap panel unit root test developed by Smith et al. (2004) and it is determined that variables are stationary at first differences. Afterwards, it is found that long-term relationships between variables with the help of panel bootstrap cointegration test developed by Westerlund and Edgerton (2007). Finally, the effects of IPI and CPI on CDS are estimated by using the coefficient estimation method introduced by Pesaran and Smith (1995). Accordingly, while the CPI has a significant effect on CDS, the effect of IPI on CDS is not statistically significant for the panel. 1 unit rise in CPI causes an increase 14 units in CDS. However, these relationships are different from depending on country. The reason for this is that the model is heterogeneous. In this context, increases in IPI affect CDS for China, India, Turkey and South Africa. The increase in IPI causes a decrease CDS for these countires except for South Africa. On the other hand, increases in CPI are effective on CDS for Brazil, India, Russia and South Africa. The increase in CPI causes an increase in CDS for these countries except for India.

Key Words: CDS, Inflation, Economic Growth, Panel Cointegration Test, BRICS.

Jel Codes: G15, O40, E44.

1.GİRİŞ

Dünyanın küresel bir pazar haline geldiği günümüzde yatırımcıların yatırım yaparken karşılaşacağı riskler hakkında bilgi sahibi olması son derece önemlidir. Ancak her bir piyasa aktörünün bu bilgiye bireysel olarak ulaşması oldukça zahmetli ve masraflıdır. Bu nedenle yatırımcılar yatırım kararı almadan önce karşı karşıya kalacakları riskleri daha az çabayla ve daha az masrafla öğrenme yoluna giderler. Bu durumda yatırımcıların karşısına ülke risklerini gösteren çeşitli risk göstergeleri çıkmaktadır. Bu risk göstergelerinin başında ise ülke kredi notları ve kredi risk primleri gelmektedir.

Ülke kredi notları kredi derecelendirme kuruluşları adı verilen bir takım bağımsız kuruluş tarafından ülkelere, kredibiliteleri dahilinde verilen alfa numerik göstergeleri tanımlamaktadır. Kredi derecelendirme kuruluşları çok sayıda iktisadi ve politik faktörü değerlendirerek her bir ülke için bir

kredi notu belirler ve bu notlar anlaşılması kolay bir takım sembollerle ilan edilir. Bu semboller ülkelerin kredibiliteleri hakkında yatırımcılara yol gösterir. Öte yandan yatırımcıların yakından takip ettiği önemli bir risk göstergesi de CDS'lerdir. CDS'ler kısaca, CDS alıcısını kredinin geri ödenmeme riskine karşı garanti altına alan kredi türev enstrümanı olarak tanımlanır (Kliber, 2011, s.112). Genel olarak kredi risk primi şeklinde telaffuz edilen CDS'ler piyasa riskini eş anlamlı göstermesi bakımından piyasa aktörleri tarafından yakından takip edilmektedir.

CDS kontratları çeşitli finansal borçlanma senetleri için düzenlenebileceği gibi ülkelerin borçlanma senetleri için de düzenlenebilir. Bu özelliğiyle CDS'ler ülkelerin kredibilitesi hakkında önemli ipuçları sunar. CDS'lerin ülke riskini gösteriyor olması, ekonomik ve politik faktörler ile de yakından ilişkili olduğu anlamını taşımaktadır. Literatürde de CDS'ler ile ekonomik ve politik değişkenler arasındaki ilişkileri inceleyen çok sayıda çalışma mevcuttur. Bu çalışmanın amacı da seçilmiş ülkeler için CDS primleri ile temel makroekonomik değişkenler arasındaki ilişkiyi analiz etmektir. Bu amaca yönelik olarak çalışmada BRICS-T (Brezilya, Rusya, Hindistan, Çin, Güney Afrika ve Türkiye) ülkeleri için CDS primleri ile enflasyon ve iktisadi büyüme arasındaki ilişkiler analiz edilmektedir. Çalışmada iktisadi büyümeyi temsilen sanayi üretim endeksi, enflasyonu temsilen tüketici fiyat endeksi kullanılmaktadır. Çalışmada kullanılan veri seti ve yöntemle dair bilgiler yöntem başlığı altında detaylı olarak verilmektedir. Çalışma bu giriş kısmı ile birlikte, literatür, yöntem ve bulgular ile sonuç başlıkları olmak üzere temel olarak dört bölümden oluşmaktadır.

2.LİTERATÜR

CDS'lerin makroekonomik değişkenlerle olan ilişkisini incelediğimizde literatürde çeşitli ekonomik değişkenlerin kredi risk primleri üzerinde etkili olduğu görülmektedir. Bu bağlamda ekonomik büyüme, cari açık/GSYH, risksiz oran, borç/GSYH, borç /İhracat, rezervler/İthalat, rezervler/Borç, enflasyon, reel döviz kuru, hane halkının borcu ve risk iştahı, gibi değişkenler potansiyel açıklayıcı değişkenler olarak ekonometrik modellere dâhil edilmektedir. Bu değişkenler dışında ihracatın büyüme hızı, kamu gelirleri, faiz oranları ve siyasi istikrar gibi kavramlarda yapılan analizlerde değerlendirilmektedir. (Sand, 2012: 19).

Longstaff vd.(2007) yaptıkları çalışmada finansal varlıkları fiyatlama modelinde kredi risk belirleyicilerini incelemek amacıyla devlet tahvillerinin risk görünümünü araştırmışlardır. 26 gelişmiş ve yükselen ekonomileri kapsayan çalışmada Kasım 2000-Mayıs 2007 dönemine ait veriler dikkate alınmış ve elde edilen sonuçlar doğrultusunda farklı ülkelerin CDS primleri arasında yüksek korelasyonun bulunduğunu ve kredi risk primlerindeki değişikliğin %50'sinden daha fazlasının üç

temel değişken tarafından açıklandığını ortaya koymuştur. Bu değişkenler Amerikan borsası ve yüksek getirili tahvil piyasası, sermaye akışları ile küresel risk şeklindedir.

Pan ve Singleton (2008) Türkiye, Güney Kore ve Meksika üzerin yapmış oldukları çalışmada bu ülkelerin CDS primlerini incelemişler ve bu primlerin değişiminde etkili olan faktörleri değerlendirmişlerdir. Bu duruma göre ülkelere özgü ve bölgesel ekonomik risklerin dışında yatırımcıların risk iştahının da kredi risk primi üzerindeki etkisinin belirginleştiğini vurgulamışlardır.

Remolona vd.(2008) Latin Amerika, Ortadoğu ve Doğu Avrupa bölgelerinden seçilen 24 ülke üzerine Ocak 2002 ile Mayıs 2006 yılı arasında yapmış olduğu çalışmaya göre ülke risk ve risk primlerinin kısa dönemde enflasyon ile pozitif yabancı döviz rezervleri negatif yönde olduğunu belirlemişlerdir. Ayrıca volatilité endeksinin de CDS primleri üzerine olumlu yönde etkide bulunduğunu ortaya koymuşlardır.

Tang ve Yan (2010), CDS'lerin yayılması üzerine yapmış oldukları çalışmada ortalama kredi yayılmalarının GSYH'nın büyüme oranını azalttığını, ancak GSYH'nın büyüme oranındaki oynaklığı ve hisse senedi piyasasındaki atlama riskini arttırdığını ortaya koymuştur. Ayrıca çalışmalarında piyasa seviyesinde kredi yayılmalarının en önemli bileşenin yatırımcı duyarlılığını olduğunu belirtmiştir.

Bu belirtilen çalışmaların dışında son dönemde yapılan çalışmaların bir kısmı (Kliber (2014), Aizenman vd.(2013), Liu ve Morley(2012) ve Liu ve Morley (2013))CDS primlerini yerel ekonomik faktörler ile açıklarken, Longstaff (2011), Wang Yao (2014), Aksoylu ve Görmüş (2018) ve Yüksel ve Yüksel (2017) global ekonomik faktörlere bağlı olarak açıklamışlardır. Kliber'in (2014) yapmış olduğu çalışmaya göre hem Macaristan hem de Yunanistan'da ortaya çıkan krizler merkezi Avrupa ülkelerinde volatilitenin artmasına neden olmaktadır. Ancak Yunanistan'dan gelen şoklar Macaristan ile Polonya arasındaki korelasyonun artmasına, Macaristan ve Çek Cumhuriyeti piyasalarının korelasyonuna ise daha az oranda katkıda bulunmaktadır.

Liu ve Morley (2012), CDS primleri üzerinde döviz kurunun en önemli etkiye sahip olduğunu, ülkedeki faiz oranlarının da sadece sınırlı bir etkisinin bulunduğunu ortaya koymuşlardır. Liu ve Morley (2013), kredi notları ile CDS primleri arasında ilişki konusunda az kanıt olduğunu belirtmişlerdir. Ayrıca kredi notları ile CDS primleri arasında ilişkinin belirleyicilerinin de ekonominin sağlıklı olduğunu da ortaya koyan makroekonomik değişkenler olduğunu vurgulamışlardır. Buna göre döviz kuru, endüstriyel üretim, fiyat endeksinin payı ile işsizlik oranının istatistiki olarak bu primler üzerinde anlamlı bir etkiye sahip olduğunu belirtmişlerdir.

Aizeman (2013), 50 ülkenin ülke riskinin fiyatlanmasında mali alanı oluşturan unsurlar (borç/vergi ve açıklar/vergi) ile diğer ekonomik faktörlerin etkisi araştırılmış ve beş ülke (Yunanistan,

İrlanda, İtalya, Portekiz ve İspanya) üzerine odaklanılmıştır. Yapılan tahminlere göre mali alan ve diğer ekonomik faktörler istatistiki ve ekonomik olarak anlamlı sonuçlar ortaya koymaktadır.

CDS primini global ekonomik faktörler açısından değerlendiren Longstaff vd. (2011) kredi riskinin global faktörlerle ilişkili olduğunu ve global faktörlerin yerel ekonomik ölçümlere göre daha etkili olduğunu vurgulamıştır. Ayrıca volatilité risk priminin de CDS primleri üzerinde anlamlı bir ilişki içerisinden bulunduğunu belirtmişlerdir.

Wang ve Yao (2014), Ağustos 2006 Eylül 2010 yılları arasında 6 Latin Amerika ülkesinde CDS primini ve volatilitésini etkileyen finansal bileşenler Lehman'ın iflası öncesi ve sonrasına yönelik olarak incelemiştir. Global risk algısını gösteren VIX endeksi ile ülke risk primi arasında Lehman'ın iflası öncesinde anlamlı bir ilişki bulunurken, sonrasında anlamlı bir ilişkinin bulunmadığını ve Yunanistan krizinin etkisinin Latin Amerika CDS primleri üzerinde anlamlı olduğunu ortaya koymuşlardır. Ayrıca sonrasında likidite riskinin öneminin arttığını vurgulamışlardır.

Yüksel ve Yüksel (2017), 19 ülke için Avrupa Borç krizi döneminde CDS primindeki değişimi ve volatilitéyi etkileyen global risk faktörlerini değerlendirmiştir. Yunanistan borç krizinin CDS primi ile ilişkili olduğunu ve incelenen ülkelerin çoğunda VIX endeksi (global risk algısını göstermektedir.) ile bu primler arasında pozitif yönlü bir ilişki olduğunu belirtmişlerdir. Ayrıca VIX endeksi CDS priminin volatilitésini arttırmada güçlü bir etkiye sahiptir.

Aksoylu ve Gümüş (2018), 9 gelişmekte olan ülke (Türkiye, Brezilya, Arjantin, Meksika, Polonya, Endonezya, Malezya, Filipinler ve Portekiz) için 2005-2015 yılları arasında CDS primleri ile döviz kuru (Amerikan doları) 10 yıl vadeli Amerikan devlet tahvili faiz oranı gibi yerel ekonomik faktörlerin arasındaki ilişki dışında global risk endeksi de modele dahi edilmiş tir. Bu duruma göre döviz kurundan CDS primlerine doğru Endonezya ve Polonya'da nedensellik ilişkisi görülürken, diğer ülkelerde böyle bir ilişkiye rastlanmamıştır. VIX endeksinden CDS primlerine doğru Arjantin, Endonezya, Filipinler, Malezya ve Polonya'da nedensellik ilişkisi ortaya çıkmıştır.

3. VERİ VE MODEL

BRICS+T (Brezilya, Rusya, Hindistan, Çin, Güney Afrika ve Türkiye) ülkelerinde 2015M12-2018M06 dönemi için aylık sanayi üretim endeksi (IPI) ile enflasyon (CPI)¹⁰ değişkenlerinin kredi risk swapı (CDS)¹¹ üzerindeki etkilerinin araştırıldığı bu çalışmada değişkenler arasındaki ilişkiler aşağıda görülen 1 nolu model kullanılarak araştırılmıştır;

¹⁰ IPI ve CPI değişkenlerine ait veriler OECD veri tabanından elde edilmiştir.

¹¹ CDS değişkenine ait veriler <http://cbonds.com/> sitesinden elde edilmiştir.

$$CDS_{i,t} = \alpha_0 + \alpha_1 CPI_{i,t} + \alpha_2 IPI_{i,t} + e_{i,t} \quad (1)$$

1 nolu modelde yer alan α_0 modelin sabit terim katsayısını, α_1 ve α_2 ise bağımsız değişkenlere ait eğim katsayılarıdır. Bu katsayıların beklenen işareti sırasıyla pozitif ve negatiftir. $e_{i,t}$ ise modelin hata terimidir. i ve t indisleri kullanılan değişkenlerin birer panel veri olduğunu sembolize etmektedir. $i=BRICS+T$ ülkeleri olmak üzere panelin yatay kesitini, $t=2015M12, 2016M01, \dots, 2018M06$ olmak üzere panelin zaman boyutunu ifade etmektedir. CPI ile IPI'de meydana gelen değişmelerin CDS üzerinde etkilerinin olması beklenmektedir.

4.YÖNTEM VE BULGULAR

CPI ile IPI'nin CDS üzerindeki etkilerini incelediğimiz bu çalışmada dinamik panel veri analizleri kullanılmıştır. Çalışmanın ampirik kısmı beş aşamadan oluşmaktadır. Birinci aşamada değişkenlerde yatay kesit bağımlılığı Breusch ve Pagan (1980) tarafından geliştirilen LM, Pesaran (2004) tarafından geliştirilen LM ve CD ve son olarak Baltagi, Feng ve Kao (2012) tarafından geliştirilen LM testleri kullanılarak analiz edilmiştir. Yatay kesit bağımlılığı testinin yapılmasındaki amaç daha sonraki aşamalarda kullanılacak analizlerin belirlenmesidir. Eğer değişkenlerde yatay kesit bağımlılığı varsa ikinci nesil yoksa birinci nesil analizler kullanılmaktadır. Bu testlerde H_0 : yatay kesit bağımlılığı olmadığını göstermektedir. Eğer hesaplanan istatistiklerin olasılık değerleri anlamlılık düzeylerinden küçükse H_0 reddedilmektedir. Bunun anlamlı değişkenlerde yatay kesit bağımlılığı olduğudur. Yukarıda da ifade edildiği gibi bu durumda ikinci nesil testler kullanılarak analize devam edilmelidir. Tablo 1'de değişkenlere ait yatay kesit bağımlılığı test sonuçları görülmektedir. Tüm testler için üç değişkenin de yatay kesite sahip olduğu bulgusuna ulaşılmıştır.

Tablo 1-Değişkenlere ait Yatay Kesit Bağımlılığı Test Sonuçları

| Değişkenler: | CDS | | CPI | | IPI | |
|---------------------------------|-----------------------|----------|-----------------------|----------|-----------------------|----------|
| | Hesaplanan İstatistik | Olasılık | Hesaplanan İstatistik | Olasılık | Hesaplanan İstatistik | Olasılık |
| Breusch-Pagan LM | 220.51* | 0.001 | 136.75* | 0.001 | 91.68* | 0.001 |
| Pesaran scaled LM | 36.42* | 0.001 | 21.13* | 0.001 | 12.90* | 0.001 |
| Bias-corrected scaled LM | 36.31* | 0.001 | 21.02* | 0.001 | 12.79* | 0.001 |
| Pesaran CD | 14.13* | 0.001 | 2.17* | 0.001 | 5.30* | 0.001 |

* Bütün istatistiksel anlamlılık düzeylerine göre değişkenlerde yatay kesit bağımlılığı vardır.

Yatay kesit bağımlılığının testinden sonra çalışmasının ikinci aşamasında değişkenlerin durağanlık seviyeleri incelenmiştir. Değişkenlerde yatay kesit bağımlılığı varlığı ikinci nesil panel birim kök testlerinin kullanılmasını gerektirmektedir. Bu sebeple Smith, Laybourne, Kim ve Newbold (2004)

tarafından geliştirmiş birim kök testi kullanılarak değişkenlerin durağanlık seviyeleri belirlenmiştir. Bootstrap'a dayalı olarak geliştirilen bu testte IPS (t), Max, LM, Min.LM ve WS istatistikleri olmak üzere beş tane istatistik hesaplanmaktadır. Testte H_0 : değişkenlerde birim kökün varlığını; dolayısıyla değişkenlerin durağan olmadığını ifade etmektedir. Ancak hesaplanan istatistiklerin olasılık değerleri istatistiki anlamlılık düzeylerinden küçük olması durumunda H_0 reddedilmekte ve değişkenlerin durağan oldukları tespit edilmektedir. Tablo 2'de çalışmada kullanılan değişkenlerin sabitli ve sabitli-trendli model için birim kök test sonuçları görülmektedir. Bu sonuçlara göre çalışmada kullanılan üç değişkenin de her iki model için (sabitli ve sabitli-trendli model) birinci farklarında durağan oldukları bulgusuna ulaşılmaktadır. Değişkenlerin tamamı $I(1)$ 'dir.¹²

Tablo 2-.Smith vd. (2004) Birim Kök Test Sonuçları

| CDS | | | | |
|-------------------------------|----------------|----------------|-----------------------|----------------|
| Test Adı | Sabitli Model | | Sabitli-Trendli Model | |
| | Seviye | Birinci Farkı | Seviye | Birinci Farkı |
| IPS İstatistiği(Olasılık) | -2.19 (0.062) | -4.25 (0.001)* | -1.35 (0.951) | -4.69 (0.001)* |
| Max İstatistiği (Olasılık) | -0.04 (0.979) | -3.93 (0.001)* | -1.30 (0.856) | -4.30 (0.001)* |
| LM İstatistiği(Olasılık) | 5.01 (0.057) | 11.25 (0.001)* | 2.40 (0.957) | 12.88 (0.001)* |
| Min.LM istatistiği(Olasılık) | 2.08 (0.355) | 10.43 (0.001)* | 2.25 (0.880) | 11.86 (0.001)* |
| WS istatistiği(Olasılık) | -0.67 (0.860) | -4.01 (0.001)* | -1.18 (0.987) | -4.64 (0.001)* |
| CPI | | | | |
| Test Adı | Sabitli Model | | Sabitli-Trendli Model | |
| | Seviye | Birinci Farkı | Seviye | Birinci Farkı |
| IPS İstatistiği(Olasılık) | -1.46 (0.523) | -4.23 (0.001)* | -2.30 (0.600) | -4.30 (0.001)* |
| Max İstatistiği (Olasılık) | -0.53 (0.871) | -2.90 (0.001)* | -1.34 (0.846) | -3.11 (0.001)* |
| LM İstatistiği(Olasılık) | 2.68 (0.621) | 10.93 (0.001)* | 5.54 (0.341) | 11.57 (0.001)* |
| Min. LM istatistiği(Olasılık) | 1.87 (0.451) | 7.36 (0.001)* | 3.38 (0.610) | 8.15 (0.001)* |
| WS istatistiği(Olasılık) | -0.96 (0.713) | -3.20 (0.001)* | -1.97 (0.645) | -3.67 (0.001)* |
| IPI | | | | |
| Test Adı | Sabitli Model | | Sabitli-Trendli Model | |
| | Seviye | Birinci Farkı | Seviye | Birinci Farkı |
| IPS İstatistiği(Olasılık) | -1.81 (0.186) | -7.62 (0.001)* | -2.62 (0.095) | -7.48 (0.001)* |
| Max İstatistiği (Olasılık) | -1.61 (0.048)* | -7.61 (0.001)* | -2.60 (0.012)* | -7.47 (0.001)* |
| LM İstatistiği(Olasılık) | 3.70 (0.214) | 19.04 (0.001)* | 6.51 (0.110) | 19.07 (0.001)* |
| Min. LM istatistiği(Olasılık) | 3.11 (0.064) | 19.03 (0.001)* | 6.44 (0.016)* | 19.06 (0.001)* |
| WS istatistiği(Olasılık) | -1.61 (0.123) | -7.92 (0.001)* | -2.94 (0.009)* | -7.85 (0.001)* |

%5 anlamlılık düzeyine göre durağanlığı ifade etmektedir.

¹² IPI değişkeni sabitli model için Max İstatistiğine göre $I(0)$ ve sabitli-trendli modelde ise IPS ve LM istatistiklerine göre $I(1)$ 'dir.

Değişkenlerin durağanlık seviyelerinin belirlenmesinden sonra üçüncü aşamada 1 nolu modelde eğim katsayılarının homojen olup olmadığı Pesaran ve Yamagata (2008) tarafından geliştirilen test yardımıyla incelenmiştir. Bu testte $\tilde{\Delta}$ ve $\tilde{\Delta}_{adj}$ istatistikleri kullanılarak modelde homojenlik araştırılmaktadır. Testte H_0 : homojenliği ifade etmektedir. Homojenlik tüm ülkeler için α_1 ve α_2 birbirine eşit olduğunu ifade etmektedir. Eğer hesaplanan istatistiklerin olasılık değerleri istatistiki anlamlılık düzeylerinden küçükse H_0 reddedilmektedir. Bu durumda ise modelin heterojen olduğu yani α_1 ve α_2 'nin ülkeden ülkeye değiştiği anlamına gelmektedir. Tablo 3'de görüldüğü üzere hesaplanan istatistiklerin olasılık değerleri %5 gibi istatistiki anlamlılık düzeyinden küçüktür. Bu durumda 1 nolu model heterojen yapıdadır.

Tablo 3. Homojenlik Testi Sonuçları

| Test | Test İstatistiği | Olasılık |
|------------------------|------------------|----------|
| $\tilde{\Delta}$ | 16.969* | 0.0001 |
| $\tilde{\Delta}_{adj}$ | 17.921* | 0.0001 |

*%5 istatistiki anlamlılık düzeyine göre heterojenliği göstermektedir.

Çalışmanın beşinci aşamasında ise değişkenler arasındaki uzun dönemli ilişkiler Westerlund ve Edgerton (2007) tarafından geliştirilen eşbütünleşme testi yardımıyla incelenmiştir. Bu testin kullanılmasının neden hem yatay kesit bağımlılığı olması durumunda hem de modelde heterojenlik olması durumunda kullanılabilen bir test olmasıdır. Testte “ H_0 : modelde eşbütünleşme vardır” şeklindedir. Westerlund ve Edgerton (2007) hipotezleri test amacıyla LM istatistiği kullanılmaktadır. Bu istatistiğe ait iki tane olasılık değeri hesaplanmaktadır. Hesaplanan bu olasılık değerlerinden birincisi bootstrap olasılık değeri, ikincisi ise asimptotik olasılık değeridir. Bunlardan birincisi yatay kesit bağımlılığı olması durumunda geçerlidir. Çalışmada kullanılan değişkenlerde yatay kesit bağımlılığı olmasından dolayı hipotezleri test etmek için bootstrap olasılık değeri dikkate alınmaktadır. Tablo 4’de eşbütünleşme test sonuçları görülmektedir. Sabitli model için hem OLS hem de Yule-Walker tahmincilerine göre bootstrap olasılık değeri istatistiki anlamlılık düzeylerine ait olasılık değerlerinden büyük olduğu için H_0 reddedilememektedir. Bu durumda değişkenler arasında eşbütünleşme ilişkisinin olduğu bulgusuna ulaşılmaktadır. Ayrıca sabitli-trendli model sonuçlarına bakıldığında sadece Yule-Walker tahmincisine göre eşbütünleşme ilişkisinin olduğu görülmektedir. Sabitli model dikkate alındığına uzun dönemde CPI ve IPI’nin CDS üzerinde etkisinin olduğu eşbütünleşme test sonuçlarında görülmektedir.

Tablo 4. Westerlund ve Edgerton (2007) Eşbütünleşme Test Sonuçları

| Sabit Terimli Model -OLS Tahmincisi Sonuçları | | |
|---|---------------------------|-----------------|
| <i>LM İstatistiği</i> | <i>Bootstrap Olasılık</i> | <i>Olasılık</i> |
| 3.623 | 0.194* | 0.001 |
| Sabit Terimli Model -Yule Walker Tahmincisi Sonuçları | | |
| <i>LM İstatistiği</i> | <i>Bootstrap Olasılık</i> | <i>Olasılık</i> |
| 3.626 | 0.546* | 0.001 |
| Sabit Terimli ve Trend Terimli Model -OLS Tahmincisi Sonuçları | | |
| <i>LM İstatistiği</i> | <i>Bootstrap Olasılık</i> | <i>Olasılık</i> |
| 3.546 | 0.039 | 0.001 |
| Sabit Terimli ve Trend Terimli Model -Yule Walker Tahmincisi Sonuçları | | |
| <i>LM İstatistiği</i> | <i>Bootstrap Olasılık</i> | <i>Olasılık</i> |
| 3.546 | 0.483* | 0.001 |

*%5 anlamlılık düzeyine göre eşbütünleşme ilişkisi göstermektedir.

Son olarak altıncı aşamada değişkenler arasında eşbütünleşme ilişkilerinin olduğunu belirlenmesinden sonra eşbütünleşme katsayı tahminleri yapılmıştır. Katsayı tahminlerini yapabilmek için hem panelin geneli hem de ülkeler için tek tek katsayı hesaplayan Pesaran ve Smith (1995) tarafından geliştirilmiş olan Mean Group (MG) tahmincisi kullanılmıştır. Anlaşılabileceği üzere kullanılan tahminci modelin heterojen olması durumunda kullanılabilen bir tahmincidir. Tablo 5’de panel için tahmin edilen eşbütünleşme katsayıları görülmektedir. Katsayılar incelendiğinde BRICS+T ülkelerinin CPI’lerinde meydana gelen 1 birimlik değişime CDS’leri 14.52 birim artırmaktadır. Ancak IPI’nın CDS üzerinde istatistiki olarak anlamlı etkisinin olmaması ile birlikte işaretinin beklenildiği gibi negatif olduğu görülmektedir. Daha açık bir ifadeyle bulguların anlamı, BRICS+T ülkelerinde CDS’ler üzerinde sadece enflasyon anlamıyla, iktisadi büyüme anlamıyla değildir. Ancak buradaki katsayılar panele ait ortak bir katsayıdır. Modelde heterojen yapı olmasından dolayı bu etkiler ve anlamlılıklar ülkeden ülkeye göre değişebilir.

Tablo 5- Pesaran ve Smith (1995) Katsayı Tahmini (Panel)

| Değişken | Katsayı | z istatistiği | Olasılık |
|-----------------|----------------|----------------------|-----------------|
| CPI | 14.52* | 2.4 | 0.016 |
| IPI | -2.95 | -0.67 | 0.501 |
| Sabit | 425.05 | 0.91 | 0.362 |

Wald Chi2 =19.26

Prob > chi2= 0.001

*%5 istatistiki anlamlılık düzeyine göre anlamlılığı ifade etmektedir.

Tablo 6'da ülkelere ait eşbütünleşme katsayı tahminleri görülmektedir. Katsayı değerleri ve anlamlılıklar incelendiğinde ülkeden ülkeye farklılıkların olduğu göze çarpmaktadır. Brezilya için sadece panelin tamamında olduğu gibi CPI'in CDS üzerinde etkisi vardır ve CPI'da meydana gelen 1 birimlik artış CDS'i 24.26 birim artırmaktadır. Benzer şekilde Rusya için anlamlı olan tek değişken CPI'dır. CPI'da meydana gelen 1 birimlik artış Rusya'ya CDS değerini 20.40 birim artırmaktadır. Hindistan ve Güney Afrika'da ise hem CPI hem de IPI, CDS üzerinde istatistiki olarak anlamlı etki etmektedir. Hindistan için CPI'da meydana gelen 1 birimlik artış CDS değerini -2.75 birim, IPI'de meydana gelen 1 birimlik artış ise CDS değerini -2.65 birim azaltmaktadır. Burada CPI'in beklenen işaretini Hindistan için farklı olduğu bulgusu da ortaya çıkmaktadır. Güney Afrika için ise her iki bağımsız değişkene ait katsayıların işareti pozitiftir. CPI'da meydana gelen 1 birimlik artış Güney Afrika CDS'ni 36.20 birim, IPI'de meydana gelen 1 birimlik artış ise 14.79 birim artırmaktadır. Çin ve Türkiye'de ise sadece IPI'deki değişimler CDS üzerinde etkilidir. Çin'in IPI'sinde meydana gelen 1 birimlik artış CDS değerini -18.82 birim azaltmaktadır. Türkiye'de ise bu değer -6.28'dir.

Tablo 6. Pesaran ve Smith (1995) Katsayı Tahmini (Ülkeler)

| Brezilya İçin Katsayılar | | | | Rusya İçin Katsayılar | | | |
|--------------------------|---------|---------------|----------|-----------------------|---------|---------------|----------|
| Değişken | Katsayı | z istatistiği | Olasılık | Değişken | Katsayı | z istatistiği | Olasılık |
| CPI | 24.26* | 8.63 | 0.001 | CPI | 20.40* | 6.93 | 0.001 |
| IPI | -2.37 | -0.83 | 0.409 | IPI | -2.40 | -0.88 | 0.380 |
| Sabit | 342.52 | 1.21 | 0.225 | Sabit | 334.50 | 1.12 | 0.262 |

| Çin İçin Katsayılar | | | | Türkiye İçin Katsayılar | | | |
|---------------------|-----------|---------------|----------|-------------------------|---------|---------------|----------|
| Değişken | Katsayı | z istatistiği | Olasılık | Değişken | Katsayı | z istatistiği | Olasılık |
| CPI | 3.51 | 0.29 | 0.770 | CPI | 5.53 | 1.45 | 0.148 |
| IPI | -18.82** | -1.79 | 0.074 | IPI | -6.28* | -4.66 | 0.001 |
| Sabit | 2084.66** | 1.85 | 0.064 | Sabit | 862.40* | 7.07 | 0.001 |

| Hindistan İçin Katsayılar | | | | Güney Afrika İçin Katsayılar | | | |
|---------------------------|---------|---------------|----------|------------------------------|-----------|---------------|----------|
| Değişken | Katsayı | z istatistiği | Olasılık | Değişken | Katsayı | z istatistiği | Olasılık |
| CPI | -2.75** | -1.78 | 0.075 | CPI | 36.20* | 5.74 | 0.001 |
| IPI | -2.65* | -4.12 | 0.001 | IPI | 14.79* | 2.47 | 0.013 |
| Sabit | 391.70* | 5.53 | 0.001 | Sabit | -1465.47* | -2.44 | 0.015 |

*,** sırasıyla %5 ve %10 istatistiki anlamlılık düzeyine göre anlamlılığı ifade etmektedir.

5.SONUÇ

BRICS+T ülkeleri için enflasyonun ve iktisadi büyümenin CDS üzerindeki etkilerinin incelendiği bu çalışmada bahsi geçen değişkenler arasında uzun dönemli ilişkilerin olduğu yapılan eşbütünleşme testi sonucunda tespit edilmiştir. Ayrıca ülkelerin heterojen yapıda olmalarından dolayı her iki bağımsız değişkenin etkisi ve anlamlılığı da ülkeden ülkeye değişmektedir. Genel olarak enflasyon değişkenine

ait katsayıların işaretine bakıldığında Hindistan hariç tüm ülkelerde katsayı beklenildiği gibi pozitifdir. İktisadi büyüme değişkenine ait katsayıların işaretine bakıldığında ise Güney Afrika hariç tüm ülkelerde katsayı beklenildiği gibi negatiftir. Anlamlılıklarına bakıldığında ise enflasyon değişkeni Brezilya, Rusya, Hindistan ve Güney Afrika için, iktisadi büyüme değişkeni ise Çin, Türkiye, Hindistan ve Güney Afrika ülkeleri için anlamlı bir şekilde CDS üzerinde etkilidir.

Elde edilen bulgular enflasyon ve iktisadi büyüme gibi makro iktisadi değişkenlerin CDS'lerin değişimi açısından önemli faktörler olduğunu göstermektedir. İncelenen 6 ülke içinde her bir değişkenden en az biri ülkelerin CDS'ni etkilemesi dışarıdan gelecek yatırımcıların ülkelerin makro iktisadi değişkenlerini takip ettiği ve bunlara göre de hareket edeceği hakkında ipucu vermektedir.

Çin, Türkiye ve Hindistan örneğinde görüldüğü üzere iktisadi büyümenin artması CDS'leri negatif etkilemektedir. Bunun anlamı eğer ülkeler sürdürülebilir bir şekilde büyümeye devam etmeleri halinde CDS'in azalacağı; CDS'in azalması da ülke risklerinin azaldığını ve böylece de yatırımcıların veya tasarruf sahiplerinin bu ülkelere yönelik yatırımlarını artıracaklarını göstermektedir. Ancak Güney Afrika bu ilişkinin pozitif olması üzerine tartışılması gereken bir konudur. Bunun da nedeni Güney Afrika'nın diğer ülkelere göre Gayri Safi Yurt İçi Hasıla sıralamasında daha gerilerde olması gösterilebilir.

Enflasyon oranlarının yükselmesi yani fiyat istikrarının olmaması hem makro iktisadi olarak hem de yatırımcılar açısından istenmeyen bir olgudur. Bu sebepten dolayı enflasyonun artması ülkelerin risk primlerinin artmasına neden olmaktadır. Bu durum fiyat istikrarının yatırımcıların risk algısı üzerine ne kadar etkili olduğunu gösteren önemli bir bulgudur. Brezilya, Rusya ve Güney Afrika ülkeleri için bunun geçerli olduğu yapılan analizler sonucunda söylenebilir. Hindistan'da ise bu oranın ters yönlü çıkması da tartışılması gereken önemli bir konudur.

Sonuç olarak ülkeler için makro iktisadi değişkenlerin CDS üzerinde etkisinin olması kaçınılmazdır. Ancak bu etkiler ülkeden ülkeye göre değişmektedir. Bunların daha sonra yapılacak çalışmalarda derinlemesine incelenmesi önem arz etmektedir. Ayrıca daha önce yapılan çalışmalarda da görüldüğü üzere CDS'ler sadece iktisadi olaylardan değil politik olaylardan da etkilenmektedir. Açıklamalarda bu durumun da göz önünde bulundurulması faydalı olacaktır.

KAYNAKÇA

Aizenman, J., Hutchison, M., ve Jinjark, Y. (2013) "What is the Risk of European Sovereign Debt Defaults? Fiscal Space CDS Spreads and Market Mispricing of Risk", *Journal of International Money and Finance*, 34: 37-59.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Aksoylu E. ve Görmüş Ş.(2018) “Gelişmekte Olan Ülkelerde Ülke Riski Göstergesi Olarak Kredi Temerrüt Swapları: Asimetrik Nedensellik Yöntemi”, *Ekonomik ve Sosyal Araştırmalar Dergisi*, 14(1): 15-33.
- Baltagi, B., Feng, Q. ve Kao, C. (2012) “A Lagrange Multiplier Test for Cross-Sectional Dependence in a Fixed Effects Panel Data Model”, Syracuse University, Center for Policy Research.
- Breusch, T. S. ve Pagan, A. R. (1980) “The lagrange multiplier test and its applications to model specification in econometrics”, *Review of Economic Studies*, 47(1): 239-253.
- Kliber, A. (2011) “Sovereign CDS Instruments in Central Europe-Linkages and Interdependence”, *Dynamic Econometric Models*, 11: 111-128.
- Kliber, A. (2014) “The Dynamics of Sovereign Credit Default Swaps and the Evolution of the Financial Crisis in Selected Central European Economies”, *Finance a úvěr-Czech Journal of Economics and Finance*, 64(4): 330-350.
- Liu, Y. ve Morley, B. (2012) “Sovereign Credit Default Swaps and the Macroeconomy”, *Applied Economics Letters*, 19(2): 129-132.
- Liu, Y. ve Morley, B. (2013) “Sovereign Credit Ratings, The Macroeconomy and Credit Default Swap Spread”, *Brussels Economic Review- Cahiers Economiques De Bruxelles*, 56(3/4): 335-348.
- Longstaff F.A., Pan J., H. Pedersen L. H. ve Singleton K.J.(2007) “How Sovereign is Sovereign Credit Risk?”, NBER Working Papers Series, <https://www.nber.org/papers/w13658.pdf>
- Longstaff, F. A., Pan, J., Pedersen, L.H., ve Singleton, K. J. (2011) “How Sovereign is Sovereign Credit Risk?”, *American Economic Journal: Macroeconomics*, 3(2): 75-103.
- Pan, J., ve Singleton, K. J. (2008) “Default and recovery implicit in the term structure of sovereign CDS spreads”, *The Journal of Finance*, 63(5): 2345-2384.
- Pesaran, M. Hashem. ve Smith, Ron P. (1995) “Estimating long-run relationships from dynamic heterogeneous panels”, *Journal of Econometrics*, 68: 79-113.
- Pesaran, M.H. (2004) “General Diagnostic Tests for Cross Section Dependence in Panels”, *Cambridge Working Papers in Economics*, doi:<https://doi.org/10.17863/CAM.5113>.
- Pesaran, M.H. ve Yamagata, T. (2008) “Testing Slope Homogeneity in Large Panels”, *Journal of Econometrics*, 142(1): 50-93.
- Remolona, E. M., Scatigna, M. ve Wu, E. (2008) “The Dynamic Pricing of Sovereign Risk in Emerging Markets: Fundamentals and Risk Aversion”, *The Journal of Fixed Income*, 17(4): 57-71.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Sand, H. J. H. (2012) “The Impact of Macro-Economic Variables on the Sovereign CDS Spreads of the Eurozone Countries”, Master’s Thesis, University of Groningen.

Smith, L.V., Leybourne, S., Kim, T.H. ve Newbold, P. (2004) “More Powerful Panel Data Unit Root Tests with An Application to Mean Reversion in Real Exchange Rates”, Journal of Applied Econometrics, 19: 147-170.

Tang, D. Y., ve Yan, H. (2010) “Market conditions, default risk and credit spreads”, Journal of Banking & Finance, 34(4), 743-753

Wang, A.T. ve Yao, C. (2014) “Risks of Latin America Sovereign Debts Before and After the Financial Crisis”, Applied Economics, 46(14): 1665-1676.

Westerlund, J. ve Edgerton, D. (2007) “A panel bootstrap cointegration test. Economics Letters”, 97: 185–190.

Yüksel A. ve Yüksel A. (2017), Avrupa Borç Krizi Döneminde Global Risk Faktörleri ve Ülke Kredi Temerrüt Takası Primi İlişkisi: 19 Ülke Örneği, Akdeniz İ.İ.B.F. Dergisi (36): 1-18.

<http://cbonds.com/> Erişim Tarihi: 14.10.2018

<https://stats.oecd.org/> Erişim Tarihi: 14.10.2018

ICOAEF
Extended With
Social Sciences

MAKROEKONOMİK FAKTÖRLERİN FARKLI ÜLKE GRUPLARINDAN GELEN TURİST SAYILARI ÜZERİNDEKİ ETKİSİNİN İNCELENMESİ: TÜRKİYE ÜZERİNE BİR UYGULAMA

M.Oğuzhan İLBAN*

Sevgi SEZER**

M.Tahsin LİCELİ***

ÖZET

Turizm sektörü ticari hizmetlerin en önemli alt sektörlerinden birisi olup, dünya genelindeki finansal etkisi günümüz itibariyle Gayrisafi Yurtiçi Hasılanın %10'una yaklaşmıştır. Sektörün ekonomiye sağladığı kaynak diğer sektörlerle kıyasla önemli maliyet avantajına sahiptir. Bundan dolayı turizm sektöründen sağlanan kaynak ülke ekonomilerine dinamizm kazandırabilmektedir. Sektörün sağladığı bu önemli avantajdan yararlanmak isteyen ülkelerdeki turizm işletmeleri sektöre özgü rekabet ve faaliyet riskleri ile karşı karşıya kalabilmektedirler. Konu politika belirleyiciler açısından değerlendirildiğinde, turizm talebinin belirlenmesinin önemli bir finansal kaynağın planlanması konusunda yardımcı olması beklenir. Literatürde gelen turist sayıları üzerinde etkili olan çok sayıda faktör farklı birçok çalışmanın araştırma konusuna girmiştir. Bu çalışmada ise diğer çalışmalardan farklı olarak farklı ülke gruplarından gelen turist sayılarının ülkedeki makroekonomik faktörlerden nasıl ve ne yönde etkilendiğinin incelenmesi amaçlanmıştır. Buna göre, ABD Dolar kurunun, mevduat faiz oranının, işsizlik oranının ve açılan şirket sayısının farklı ülke gruplarından gelen turist sayılarını etkileyip etkilemediği eşbütünleşme ve çoklu regresyon analizi yöntemleriyle incelenmiştir. 2010–2017 dönemine ait aylık frekanstaki verilerin kullanıldığı analizlerden elde edilen sonuçlar döviz kurundaki değişimin sadece Amerika ülke grubundan gelen turist sayıları üzerinde anlamlı bir etkisinin olduğunu diğer ülke grubundan gelen turist sayıları üzerinde anlamlı bir etkisinin olmadığını ortaya koymaktadır. İşsizlik oranındaki değişimin ise Güney Asya ülke grubu hariç tüm ülke gruplarında gelen turist sayısını negatif yönde etkilediği tespit edilmiştir. Ayrıca açılan şirket sayısındaki değişimin çeşitli ülke gruplarından gelen turist sayıları üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve negatif etkisinin olduğu

* Prof.Dr., Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Gastronomi ve Mutfak Sanatları Bölüm Başkanı, e-mail: ilban@balikesir.edu.tr

** Dr.Öğr.Üyesi, Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Bankacılık ve Finans Bölümü, e-mail: sevgi.sezer@balikesir.edu.tr.

*** Araş.Gör., Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Turizm İşletmeciliği ve Otelcilik Bölümü, e-mail: liceli@balikesir.edu.tr

bulunmuştur. Son olarak faiz oranındaki değişimin gelen turist sayıları üzerinde anlamlı bir etkisine rastlanmamıştır.

Anahtar Kelimeler: *Makroekonomik Faktörler, Gelen Turist Sayısı, Ülke Grupları.*

EXAMINATION OF THE IMPACT OF MACROECONOMIC FACTORS ON THE NUMBER OF TOURIST ARRIVALS FROM DIFFERENT COUNTRY GROUPS: AN ANALYSIS ON TURKEY

ABSTRACT

The tourism sector is one of the most important sub-sectors of commercial services, and its worldwide financial impact has now approached 10% of the Gross Domestic Product. The sector's economy provides significant cost advantages compared to other sectors. Therefore, the source provided by the tourism sector can provide dynamism to the economies of the countries. Tourism enterprises in the countries that seek to benefit from this important advantage provided by the sector may encounter sector-specific competition and operational risks. Upon evaluating the issue regarding the policymakers, determining the demand for tourism is expected to help in the planning of an important financial resource. Numerous factors that have impacts on the number of tourist arrivals in the literature have entered the research topic of many different studies. In this study, it is aimed to investigate the extent to which the number of tourist arrivals from different country groups is affected by the macroeconomic factors in the country. Accordingly, whether the US Dollar exchange rate, deposit interest rate, unemployment rate and the number of companies affected the number of tourist arrivals from different country groups were examined by cointegration and multiple regression analysis. The results obtained from the analyses using the data in the monthly frequency over the period 2010–2017 indicate that the exchange rate change has a significant impact only on the number of tourist arrivals from the American country group and it does not have a significant impact on the number of tourist arrivals from the other country group. It is determined that the change in unemployment rate negatively affects the number of tourist arrivals from all-country groups except for the South Asian country group. In addition, the change in the number of companies has been found to have a statistically significant and negative impact on the number of tourist arrivals from various country groups. Consequently, the change in interest rates did not have a significant impact on the number of tourist arrivals.

Keywords: *Macroeconomic Factors, Number of Tourist Arrivals, Country Groups.*

1.GİRİŞ

Turizm, özellikle önemli miktarda döviz kazancına sahip gelişmekte olan ülkeler için dünya çapında hızla büyüyen ana sektörlerden biridir. Bu anlamda, özellikle II. Dünya Savaşı sonrasında gelişmekte olan ülkeleri gelişmiş ülkeler seviyesine yakınlaştırmak amacıyla başlatılan kalkınma süreçlerinde turizm önemli bir faktör haline gelmiştir. Turizm, sektördeki potansiyeli oldukça yüksek olan Türkiye için de önemli bir gelişme kaynağıdır. Son yıllarda, uluslararası turizm endüstrisinin gelişimi, sektördeki değişiklikler ve küresel genişleme ile birlikte, çok önemli hale gelmiştir. Modern dünyanın önemli sektörlerden biri olan turizm sektörü, birçok ülke için döviz rezervlerini biriktirmenin yanı sıra, istihdam olanaklarını artırmak ve yerel inşaat faaliyetlerini hızlandırmak için önemli bir kaynaktır. Dünya Seyahat ve Turizm Konseyi'ne (WTTC) göre, turizm sektörünün toplam üretimi 2017 yılında 8,3 trilyon ABD Dolarıdır. Sektör, küresel gayri safi yurtiçi hasılasının (GSYİH) %10,3'ünü oluşturmuş ve 313 milyon yeni istihdam fırsatı sunmuştur. Turizm, özellikle önemli miktarda döviz kazancı olan gelişmekte olan ülkeler için dünya çapında hızla büyüyen ana sektörlerden biridir. Bu anlamda, özellikle II. Dünya Savaşı sonrasında gelişmekte olan ülkeleri, gelişmiş ülkeler seviyesine daha da yakınlaşmak amacıyla başlatılan kalkınma süreçlerinde turizm önemli bir faktör haline gelmiştir (WTTC, 2018).

Uluslar daha düşük işsizlik oranı veya daha fazla istihdam imkanı, gayri safi yurtiçi hasıla (GSYİH) artışı, kişi başına düşen milli gelir yükselişi, ihracat rakamlarının ve vergi gelirlerinin artmasının elde edilmesi için çaba sarf etmektedir (Qiong ve Chen, 2018; Işık ve diğ., 2018). Turizm sektörünün dünyadaki birçok ülkenin ekonomik kalkınmasında ek işler, gelir ve vergiler yaratarak önemli bir rol oynadığı bir gerçektir (Ben Aissa ve Goaid, 2017). Bölgesel ekonomilerde zaman zaman dışsal şoklar yaşanmasına rağmen, genel küresel turizm yıllık %4 – %5 oranında büyümektedir; dış ticaretin ve finansal sektörlerin liberalleşmesinin teknolojik gelişmelerle birleşmesi bu muhtemelen büyüme hızı üzerinde etkili olmaktadır (Ongan ve diğ., 2017).

Turizm endüstrisi, ülke ekonomilerinin en önemli sektörlerinden biridir. Turizm, yıllık bazda rakamlarda büyük farklılıklar ile karakterize edilir ve sonuç olarak, gelecekteki gelişmeleri tahmin etmek çok zordur. Turist gelişlerinin tahminleri, turizm işletmecileri tarafından planlama, politika oluşturma ve bütçeleme amacıyla çok büyük önem arz eder (Crouch, 1994). Ancak ülkeye gelen turist sayılarındaki değişkenlik konuyla ilgili tahmin yapılmasını güçleştirmektedir. Çünkü gelen turist sayısı ve turizm gelirleri birçok faktörden etkilenmektedir. Bu değişkenlik, kısa veya uzun vadede planlama, politika oluşturma ve devlet düzenlemeleri üzerinde olumsuz bir etki yaratabildiği gibi, aynı zamanda bir yıl önceden rezervasyonlarını gerçekleştiren turist operatörleri için de bütçeleme konusunda aynı etkiyi yaratabilmektedir (Gounopoulos ve diğ., 2012). Bununla birlikte ülkelerin makroekonomik

şartları ve bu şartların değişkenliği de gelen turist sayıları ve turizm gelirleri gibi turizm ile ilgili faktörler üzerinde etkili olabilir. Örneğin döviz kuru düzeyinin ülkeye gelen turist sayısının önemli bir belirleyicisi olduğuna yönelik çeşitli çalışmalar bulunmaktadır. Buna göre bir ülkede uygulanan devalüasyon neticesinde meydana gelen döviz kuru farklılıkları dolaylı olarak ülkeye gelen turist sayısı üzerinde artışa veya azalışa neden olabilmektedir (Bahar, 2007). Bunun kimi zaman iki olgu arasında zıt yönlü bir nedensellik ilişkisi doğurması da olasıdır (Narayan, 2004).

Diğer bir makroekonomik faktör olan faiz oranlarının da gelen turist sayısı ve turizm gelirleri üzerinde arttırıcı veya azaltıcı etkisi olabilir. Özellikle turist karşılayan ülkelerdeki faiz oranlarının, turizm talebinin belirleyici faktörlerinden biri olduğunu ifade eden çeşitli çalışmalar bulunmaktadır. Zira, diğer tüm sektörlerde olduğu gibi turizm endüstrisinde planlanan yatırım kararları ülkedeki reel faiz oranları düzeyine oldukça hassastır (Paksoy ve Çolakoğlu, 2010).

İstihdamın turist sayısı ve turizm gelirleri üzerinde etkisinin olabileceği de çeşitli çalışmalarda ifade edilmektedir. Buna göre bir ülkedeki turizm sektörünün gelişimi, üst yapı yatırımlarında ve döviz kazançlarında yükselişe imkân verecek, bu da önemli oranda ilave istihdam olanaklarının hayata geçirilmesine destek verecektir (Ünlüönen ve Şahin, 2011). Sektör içerisinde yeni istihdam olanaklarının belirmesi yoluyla, beşeri sermaye birikimi ve kalifiye işgücün artışı sağlanacaktır. Bu durumun ise gelen turist sayısı üzerinde olumlu etki oluşturması beklenebilir (Şit, 2016).

Bu çalışmanın amacı, farklı ülke gruplarından Türkiye'ye gelen turist sayılarının ABD Dolar kuru, mevduat faiz oranı, istihdam oranı ve açılan şirket sayısından etkilenip etkilenmediğini ayrı ayrı incelemektir. Bu doğrultuda çalışma beş bölümden oluşmaktadır. İlk bölümde turizm ile ilgili bazı temel bilgilere yer verilmiş olup, ikinci bölüm makroekonomik faktörlerin turizm üzerindeki etkilerini araştıran farklı bakış açılarına sahip ampirik çalışmalardan oluşmaktadır. Çalışmanın üçüncü bölümünde analizde kullanılan verilerin nasıl temin edildiği ve yöntem açıklanmıştır. Dördüncü bölümde analizlerden elde edilen bulgular kuramsal olarak tartışılmış ve literatür ile karşılaştırılmıştır. Çalışmanın son bölümü ise kısa bir değerlendirmeden oluşmaktadır.

2.AMPİRİK LİTERATÜR

Gelen turist sayısına etki eden makroekonomik faktörlerin incelendiği ampirik literatürde konu ile ilgili farklı veri setleri ve farklı uygulamaların olduğu ve sabit bir sonucun bulunamadığı söylenebilir. Ayrıca literatürde ev sahibi ülkeye ait makroekonomik faktörlerin gelen turist sayısını ne yönde etkilediğini inceleyen çalışmalarla birlikte aynı faktörlerin giden turist sayısını ne yönde etkilediğini inceleyen çalışmalarda bulunmaktadır. Ülkelerin gelen turist sayısının veya turizm gelirinin turistlerin geldikleri ülkedeki makroekonomik faktörlerle ilgisini inceleyen araştırmalarda konuyla ilgili literatürde

yer almaktadır. Aşağıda Türkiye üzerine uygulama gerçekleştiren çalışmalar ayrı olmak kaydıyla, konuyla ilgili olan ampirik çalışmalar özetlenmiştir.

Makroekonomik faktörlerin turizm üzerine etkisinin incelendiği öncü çalışmalardan birisi olan Gu (1995) çalışmasında, 1985-1990 yılları arasındaki dönemde ABD’de faiz oranının, ABD’deki havayolu seyahati, milli park konaklaması ve daimi restoran müşteriliği üzerindeki etkisini incelenmiştir. Çalışma bulguları, faiz oranının önemli miktarda zaman ve para içeren turizm faaliyetleri üzerinde olumsuz etkisi olduğunu ortaya konmuştur. Konuyu daha farklı makroekonomik değişkenler ile inceleyen Eugenio-Martin ve diğ. (2004) çalışmasında ise turizm ile ekonomik büyüme arasındaki karşılıklı etkileşim incelenmiştir. 21 Latin ülkesinde 1985-1998 yılları arasındaki dönem için Kişi Başına düşen GSYİH, Toplam Gayrisafi Yurtiçi Yatırım, Eğitime Yönelik Kamu Harcaması, Genel Kamu Harcaması gibi makroekonomik değişkenlerin yanı sıra Siyasi İstikrar Endeksi ve Siyasi Yönetişimin Kalite Ölçeği gibi sosyal değişkenler kullanılarak Arellano-Bond Dinamik Panel analizi uygulanmıştır. Analiz sonuçlarında gelen turist sayısını, GSYİH, güvenlik, fiyatlar seviyesi, eğitim seviyesi ve altyapı yatırımlarına bağlı olarak açıklanmaya çalışılmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, düşük gelirli ülkelerin turistleri çekmek için yeterli düzeyde altyapıya, eğitime ve gelişime ihtiyaç duyduklarını göstermektedir. Orta gelirli ülkeler ise sağlık hizmetleri ve kişi başına düşen GSYİH gibi yüksek sosyal kalkınma düzeylerine ihtiyaç duymaktadır. Özellikle döviz kurunun etkilerinin incelendiği Mervar ve Payne (2007) çalışmasında otoregresif dağıtılmış gecikme (ARDL) yaklaşımı kullanılarak 1994: 1– 2004: 4 döneminde Hırvatistan’a yönelik turizm talebi incelenmiştir. Analiz sonuçları, reel döviz kuru ve nakliye maliyetlerinin, yabancı turizm talebinin istatistiksel olarak önemli belirleyicileri olmadığını ortaya konmaktadır. Benzer şekilde Lelwala ve Gunaratne (2008) çalışmasında, 1978–2007 döneminde İngiltere’den Sri Lanka’ya gelen turist sayısı üzerinde döviz kuru, tüketici fiyat endeksleri ve GSYİH’nin etkisi incelenmiştir. Analiz sonuçlarında gelirin, gelen turist sayıları üzerinde kısa dönemde herhangi bir etkisi olmadığı, döviz kurunun uzun dönemde pozitif bir etkisinin olduğu ve tüketici fiyat endekslerinin ise hem kısa hem de uzun dönemde negatif etkisinin bulunduğu sonucuna ulaşılmıştır. Kişi başına gelir ile birlikte diğer bazı makroekonomik faktörlerin incelendiği Walle (2010) çalışmasında ise Etiyopya’ya turist gönderen 40 ülkeden 1998–2004 yılları arasındaki dönemde derlenen Kişi başına düşen GSYİH, Nüfus, Kentleşme, İki Ülke Arasındaki Uzaklık, Karayolu Uzunluğu, İnternet Kullanımı ve Gelen Turist Sayısı verileri Panel Veri GMM yöntemi yardımıyla analiz edilmiştir. Analiz bulguları gelir düzeyinin gelen turist sayısını pozitif etkilediğini, Etiyopya ile Kenya arasındaki fiyat farkının ise negatif yönde etkilediğini ortaya koymaktadır. Ayrıca daha önceki yıllarda gelen turist sayısı ise cari yılın turist sayısını pozitif yönde etkilediği sonucuna ulaşılmıştır. Konuyu Tayland açısından inceleyen Jintranun vd. (2011) çalışmasında

ise Tayland'a turist gönderen 10 ülkeden 1997-2010 yılları arasındaki dönem dâhilinde derlenen Kişi başına düşen GSYİH, Fiyat Endeksi, Reel Döviz Kuru ve Gelen Turist Sayısı verileri Panel Veri GMM yöntemi yardımıyla analiz edilmiştir. Analiz bulguları, GSYİH ile uluslararası turist sayısı arasında pozitif bir ilişki olduğunu ortaya koymaktadır. Ancak döviz kuru ile ilgili gelen turist sayısı arasında negatif ilişki olduğu da elde edilen sonuçlar arasındadır. Güney Afrika'ya turist gönderen ülkelerdeki makroekonomik faktörlerin Güney Afrika'ya gelen turist sayısı üzerindeki etkisini inceleyen Eita vd. (2011) çalışmasında ise Güney Afrika'ya turist gönderen 27 ülkeye ait veri setinin oluşturduğu panel 1999–2007 yılları arasındaki dönem dâhilinde analiz edilmiştir. GSYİH, Fiyat Endeksi, Döviz Kuru, Ulaştırma Maliyetleri, Alt Yapı Durumu ve Gelen Turist Sayısı verilerinin kullanıldığı çalışmanın yöntemi Panel Veri Sabit Etkiler yöntemidir. Analiz bulguları, turist gönderen ülkelerdeki gelir ve altyapının Güney Afrika'ya gelen turist sayısı üzerinde pozitif etkili olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Ayrıca rekabetçi olarak belirlenen döviz kuru seviyesinin finansal istikrar sağlayarak Güney Afrika'ya gelen turist sayısını arttırdığı sonucu da çalışmadan elde edilen bir diğer bulgudur. Gelen turist sayısının turistlerin geldiği ülkenin makroekonomik koşullarından etkilenip etkilenmediğini inceleyen İbrahim (2011) çalışmasında, Mısır'a turist gönderen 8 ülke 1990-2008 yılları arasındaki dönem dâhilinde incelenmiştir. İlgili çalışmada Nüfus, Kişi başına düşen GSYH, Fiyat Endeksi, Reel Döviz Kuru, İki Ülke Arasındaki Dış Ticaret, Tunus'un Fiyat Endeksi ve Gelen Turist Sayısı verileri Panel Sabit Etkiler yöntemi yardımıyla analiz edilmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar gelen turistlerin geldikleri ülke GSMH'sinden pozitif olarak etkilendiklerini, döviz kurundan negatif etkilendiklerini, ticari açıktan ise pozitif etkilendiklerini ortaya koymaktadır. Benzer şekilde Surugiu vd. (2011) çalışmasında Romanya'ya turist gönderen 23 ülkenin 1997-2008 dönem dâhilinde derlenen kişi başına GSYİH, Dış Ticaret, Nüfus, İki Ülke Arasındaki Uzaklık, Fiyat Düzeyi verilerinin Gelen Turist Sayısı üzerindeki etkisi Panel Veri Sabit Etkiler yöntemi yardımıyla analiz edilmiştir. İlgili çalışmanın analiz bulguları, Kişi başına düşen GSYİH, İki-Tarafli Ticaret, Nüfus ve Fiyatların Romanya'ya yönelik turizm akışının ana belirleyicileri olduğunu göstermiştir.

Makroekonomik faktörler ile gelen turist sayılarının incelendiği ve Türkiye üzerine analiz gerçekleştiren çalışmalar arasında yer alan Demirel ve diğ. (2008) çalışmasında 1994–2006 arası dönemdeki üçer aylık veriler kullanılarak Türkiye'ye ABD, Almanya, Fransa ve İngiltere'den gelen turist sayıları üzerinde reel döviz kuru değişimi ve döviz kuru belirsizliğinin etkisi incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar reel döviz kuru belirsizliğinin Fransa hariç diğer ülkelere gelen turist sayıları üzerinde herhangi bir etki yaratmadığı sonucuna varılmıştır. Makroekonomik faktörlerin Türkiye'nin turizm sektörü üzerine etkisinin incelendiği Ketenci (2009) çalışmasında ise Türkiye'ye turist gönderen 13 ülkeden 1996–2006 yılları arasındaki dönem dâhilinde derlenen Kişi Başına düşen

GSYİH, Tüketici Fiyat Endeksi, Rakip ülkenin Tüketici Fiyat Endeksi verileri Panel ARDL modeli yardımıyla analiz edilmiştir. Analiz bulguları, değişkenler arasındaki uzun dönemli eşbütünlük ilişkisinin varlığını ortaya koymaktadır. Ayrıca, turist gönderen ülkelerin gelirinin, uzun vadede olduğu kadar kısa vadede de turizm talebi üzerinde önemli etkiye sahip olduğu belirtilmiştir. Türkiye örneğinin incelendiği bir diğer çalışma olan Görmüş ve Göçer (2010) çalışmasında ise Türkiye'ye turist gönderen 32 ülkeden 2006–2007 yılları arasındaki dönem dâhilinde çeşitli makroekonomik faktörlerin gelen turist sayısı üzerinde etkili olup olmadığı incelenmiştir. İlgili çalışmada GSYİH, Dış Ticaret Miktarı, Konaklama Potansiyeli, Nüfus, Fiyat Endeksi, Reel Döviz Kuru, Reklam Harcaması, İki Ülke Arasındaki Uzaklık, Rakip Ülke Fiyatları ve Gelen Turist Sayısı verileri Panel Veri GLS yöntemi yardımıyla analiz edilmiştir. Çalışmanın analiz bulguları, turist gönderen ülkelerin reel geliri, turist gönderen ülkeler ile Türkiye arasındaki ticaret değeri ve konaklama kapasitesinin turizm talebi ile pozitif ilişkili olduğunu göstermiştir. Ayrıca, beklentilerin aksine, nispi fiyatlar ve reel döviz kuru verilerinin turizm talebiyle pozitif ilişkili olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Benzer şekilde gelen turist sayısının turistlerin geldikleri ülkelerin makroekonomik koşullarından etkilenip etkilenmediğini inceleyen Kaya ve Canlı (2013) çalışmasında Türkiye'ye turist gönderen 24 OECD ülkesinden 1990–2010 ve 1990–2008 yılları arasındaki dönemlerden derlenen GSYİH, Fiyat düzeyi, Rakip ülkelere ait fiyat düzeyi ve Gelen Turist Sayısı verileri, Panel Veri Sabit Etkiler yöntemi yardımıyla analiz edilmiştir. Çalışmada Türkiye'ye yönelik uluslararası turizm talebinin en önemli belirleyicisinin gelir değişkeni olduğu sonucuna varılmıştır. Benzer şekilde Aydın vd. (2015) çalışmasında Türkiye'ye en fazla turist gönderen ilk 5 ülkeden 1996–2013 yılları arasındaki dönem dâhilinde derlenen GSYİH, Fiyat Endeksi, Reel Döviz Kuru, Seyahat Maliyetleri ve Gelen turist Sayısı verileri Panel Dinamik En Küçük Kareler (DOLS) ve Tam Uyarlanmış En Küçük Kareler (FMOLS) yöntemleri yardımıyla analiz edilmiştir. Analiz bulguları neticesinde turizm faaliyetlerine ilişkin fiyatların ve seyahat maliyetlerinin, turizm talebi arasında negatif ve anlamlı ilişki olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Döviz kurları ile turizm talebi arasında ise pozitif ve anlamlı ilişki olduğu tespit edilmiştir. Konuyu daha geniş bir örneklem ile inceleyen Özcan (2015) çalışmasında Türkiye'ye en çok turist gönderen ilk 20 ülkeden 1995–2011 yılları arasındaki dönem dâhilinde derlenen GSYİH, Fiyat Düzeyi, Reel Döviz Kuru, Politik İstikrar Endeksi ve Gelen Turist Sayısı verileri Panel Dinamik En Küçük Kareler (DOLS) ve Tam Uyarlanmış En Küçük Kareler (FMOLS) yöntemleri yardımıyla analiz edilmiştir. Analiz bulguları, uygulamada kullanılan tüm değişkenlerin turizm gelirinə katkı sağladığını, ancak kişi başına GSYİH ve reel döviz kuru değişkenlerinin ilgili değişkenler arasında en önemli paya sahip olduğunu göstermiştir. Konuyu Türkiye açısından daha geniş bir örneklem ile inceleyen Güneş ve Kabadayı (2015) çalışmasında ise Türkiye'ye turist gönderen 89 ülkeden 1995–2011 yılları arasındaki dönem dâhilinde derlenen GSYİH, Nüfus, İki Ülke Arasındaki Uzaklık ve Gelen Turist Sayısı verileri Panel Çekim Modeli yöntemi

yardımla analiz edilmiştir. Analiz bulguları, Türkiye'ye gelen ziyaretçilerin gelir seviyeleri ile ziyaretçilerin geldikleri ülkelerin nüfus potansiyelinin Türkiye turizm talebini anlamlı ve pozitif yönde etkilemekte olduğunu göstermektedir. Türkiye ekonomisindeki makroekonomik değişkenler ile konuyu inceleyen Dinçer ve diğ. (2015) çalışmasında, 2003–2014 yılları arasındaki dönemde turizm sektörü gelirleri ile reel efektif döviz kuru arasındaki ilişki incelenmiştir. Analiz sonuçları, turizm gelirleri ile reel efektif döviz kuru arasında bir ilişkinin ve nedenselliğin bulunmadığını ortaya koymaktadır. Benzer bir sonucu ortaya koyan Pekmezci ve Bozkurt (2016) çalışmasında da turizm gelirleri ile döviz kurları arasındaki ilişki Türkiye'deki turizm sektörü faaliyetleri açısından 2005–2015 dönemi için analiz edilmiştir. Araştırmanın bulguları neticesinde, döviz kurunun turizm gelirleri üzerinde anlamlı bir etkiye sahip olmadığı yönünde sonuca ulaşılmıştır.

3. VERİ VE YÖNTEM

Analizlerde kullanılan verilerden ilki Türkiye İstatistik Kurumu (TÜİK) turizm istatistikleri, turizm ve sınır istatistikleri listesinden, giriş çıkış yapan ziyaretçiler içerisinde yer alan, ülke gruplarına göre giriş yapan turist istatistiklerinden derlenmiştir. TÜİK tasnifine göre ilgili ülke grupları ve örnekleme de yer alan ülkeler ve ilgili gruplar için kullanılacak kısaltmalar Tablo 1'de görülebilir.

Tablo 1. Analizlere Dâhil Edilen Ülke Grupları ve Kapsamındaki Ülkeler

| Ülke Grubu | Kısaltma | Ülkeler |
|------------------------------|----------|--|
| Afrika Ülkeleri | AFRK | Cezayir, Fas, Güney Afrika Cumhuriyeti, Kenya, Libya, Mısır, Nijerya, Senegal, Sudan, Tunus, Diğer Afrika Ülkeleri. |
| Amerika Ülkeleri | AMRK | Arjantin, Brezilya, Dominik Cumhuriyeti, Ekvator, Kolombiya, Panama, Paraguay, Peru, Şili, Uruguay, Venezuela, Diğer Amerika Ülkeleri. |
| Avrupa OECD Ülkeleri | AVOEC | Almanya, Avusturya, Belçika, Çek Cumhuriyeti, Danimarka, Finlandiya, Fransa, Hollanda, İngiltere, İrlanda, İspanya, İsveç, İsviçre, İtalya, İzlanda, Lüksemburg, Macaristan, Norveç, Polonya, Portekiz, Slovakya, Yunanistan |
| Bağımsız Devletler Topluluğu | BADETO | Azerbaycan, Beyaz Rusya, Ermenistan, Gürcistan, Kazakistan, Kırgızistan, Moldova Cumhuriyeti, Özbekistan, Rusya Federasyonu, Tacikistan, Türkmenistan, Ukrayna. |
| Batı Asya Ülkeleri | BATAS | Birleşik Arap Emirlikleri, Bahreyn, Filistin, Irak, İsrail, Katar, Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti, Kuveyt, Lübnan, Suriye, Suudi Arabistan, Umman, Ürdün, Yemen. |
| Diğer Avrupa Ülkeleri | DAVRU | Arnavutluk, Bosna Hersek, Bulgaristan, Estonya, Hırvatistan, Letonya, Litvanya, Makedonya, Romanya, Sırbistan, Slovenya, Diğer Avrupa Ülkeleri. |
| Diğer OECD Ülkeleri | DOECD | ABD, Avustralya, Japonya, Kanada, Kore, Meksika, Yeni Zelanda. |

| | | |
|-------------------------|--------|--|
| Doğu Asya Ülkeleri | DASYA | Çin, Hong Kong, ve Diğer Doğu Asya Ülkeleri. |
| Güney Asya Ülkeleri | GAYSA | Afganistan, Bangladeş, Hindistan, İran, Pakistan, ve Diğer Güney Asya Ülkeleri. |
| Güneydoğu Asya Ülkeleri | GDASYA | Endonezya, Filipinler, Malezya, Singapur, Tayland, ve Diğer Güneydoğu Asya Ülkeleri. |

Analizlere dâhil edilen makroekonomik değişkenler farklı veri sağlayıcı kuruluşlardan temin edilmiş olup bunlar ABD Dolar kuru, faiz oranı, işsizlik oranı ve açılan şirket sayısı olarak belirlenmiştir. İlgili değişkenlere ait veri açıklaması, kısaltma ve veri kaynağı Tablo 2’de sunulmuştur.

Tablo 2. Analize Dâhil Edilen Makroekonomik Değişkenler

| Açıklama | Kısaltma | Veri Kaynağı |
|--------------------------------------|----------|--------------|
| ABD Dolar Alış Kuru | DOL | TCMB |
| Mevduata Uygulanan Faiz Oranı (Akım) | FAZ | TCMB |
| İşsizlik Oranı | ISZ | TÜİK |
| Açılan Şirket Sayısı (Toplam) | ACS | TOBB |

Analizlerde kullanılan veri dönemi 2010–2017 aralığı olup veri frekansı ise aylıktır. Veriler analizlere dâhil edilmeden tüm verilerin logaritması alınarak doğrusallaştırma işlemi gerçekleştirilmiştir. Buna göre değişkenlere ilişkin tanımlayıcı istatistikler Tablo 3’de görülebilir.

Tablo 3. Analizde Kullanılan Değişkenlere İlişkin Tanımlayıcı İstatistikler

| | Ortalama | Maksimum | Minimum | Std. Sap. | Jarque-Bera | Gözlem |
|--------|----------|----------|---------|-----------|-------------|--------|
| AFRK | 4,732 | 5,096 | 4,263 | 0,173 | 8,004 | 96 |
| AMRK | 4,169 | 4,557 | 3,653 | 0,229 | 3,907 | |
| AVOCD | 5,975 | 6,435 | 5,384 | 0,310 | 8,481 | |
| BADETO | 5,722 | 6,218 | 5,184 | 0,280 | 7,573 | |
| BATAS | 5,327 | 5,802 | 4,935 | 0,177 | 2,182 | |
| DAVRU | 5,353 | 5,615 | 5,012 | 0,144 | 4,927 | |
| DOECD | 4,991 | 5,319 | 4,516 | 0,232 | 7,080 | |
| DASYA | 4,230 | 4,677 | 3,720 | 0,209 | 1,523 | |
| GASYA | 5,164 | 5,558 | 4,832 | 0,161 | 1,471 | |
| GDASYA | 4,218 | 4,620 | 3,646 | 0,173 | 11,32 | |
| DOL | 0,342 | 0,588 | 0,151 | 0,129 | 7,536 | |

| | | | | | | |
|-----|-------|-------|-------|-------|-------|--|
| FAZ | 0,912 | 1,050 | 0,721 | 0,075 | 2,633 | |
| ISZ | 0,995 | 1,133 | 0,863 | 0,055 | 0,134 | |
| ACS | 3,669 | 3,852 | 3,378 | 0,102 | 4,051 | |

Tablo 3 incelendiğinde ortalamada en yüksek gelen turist sayısının Avrupa OECD ülkelerine ait olduğu görülmektedir. Ayrıca en az gelen turist sayısı ise Amerika ülkelerine aittir. Gelen turist bazında en az değişkenliğin olduğu ve böylece en istikrarlı gelen turist sayısının diğer Avrupa ülkelerine ait olduğu söylenebilir.

Zaman serilerinde durağan olmayan serilerin analizlerde kullanılması, yapılan tahminde sahte regresyonu ortaya çıkarabilir (Kutlar, 2000:252). Dickey ve Fuller (1981) çalışması ve sonrasında Phillips ve Perron (1988) çalışmasıyla zaman serilerinin durağanlığını test edebilen yöntemler geliştirilmiştir. Bu çalışmada birbirini tamamlar nitelikte özelliklere sahip Genişletilmiş Dickey Fuller (ADF) testi ile Phillips-Perron birim kök testi analizi gerçekleştirilmiştir. Bağımlı ve bağımsız değişkenin aynı anda birim kök içermesi ve aynı mertebeden durağan olmaları durumu için uzun dönemli birlikte hareket ilişkisi Johansen (1988) çalışması ile geliştirilen eşbütünleşme analizi ile incelenmiştir. Eşbütünleşme ilişkisi birim kök içeren ve birinci, farkta durağan olan seriler için incelenmiş olup eşbütünleşme modeli aşağıda yer alan Model 1'de ifade edilmiştir:

$$GET_t = \alpha + \beta_1 DOL_t + \beta_2 FAZ_t + \beta_3 ISZ_t + \beta_4 ACS_t + e_t \quad (1)$$

GET: Ülke gruplarından gelen turist sayısının logaritması (ayrı ayrı)

DOL: ABD Doları alış kurunun logaritması

FAZ: Mevduata uygulanan akım faiz oranı ortalaması

ISZ: İşsizlik oranı

ACS: Açılan şirket sayısı

e_t : Hata terimi

Model 1 eşbütünleşme ilişkisi için oluşturulduğundan analizlerde eşbütünleşme ilişkisinin olabileceği ülke grupları için uygulama gerçekleştirilmiştir. Eşbütünleşme ilişkisinin olmadığı ülke grupları ve makroekonomik değişkenler arasındaki ilişki aşağıda yer alan Model 2 çerçevesinde çoklu regresyon analizi ile incelenmiştir.

$$GET_t = \alpha + \beta_1 \Delta DOL_t + \beta_2 \Delta FAZ_t + \beta_3 \Delta ISZ_t + \beta_4 \Delta ACS_t + \beta_5 GET_{t-1} + e_t \quad (2)$$

Model 2'de yer alan "Δ" dönemlik farkı ifade etmekte olup her bir t dönemi için t-1 döneminden fark alınarak hesaplanmıştır. Ayrıca Model 2'de bağımlı değişkenin gecikmeli değerinin de (GET_{t-1})

bulunduğu görülmektedir. İlgili değişken vasıtasıyla gelen turist sayılarında dönemler arası geçişte incelenebilir.

4.BULGULAR

Analizler gerçekleştirilmeden önce çoklu doğrusal bağlantı (multicollinearity) incelemesi yapmak üzere bağımsız değişkenler arasında Spearman sıra korelasyonu gerçekleştirilmiştir. Gerçekleştirilen korelasyon analizi sonuçları Tablo 4'de incelenebilir.

Tablo 4. Bağımsız Değişkenler Arası Spearman Sıra Korelasyon Sonuçları

| | DOL | FAZ | ISZ | ACS |
|-----|-------|-------|-------|-------|
| DOL | 1 | 0.728 | 0.343 | 0.629 |
| FAZ | 0.728 | 1 | 0.304 | 0.542 |
| ISZ | 0.343 | 0.304 | 1 | 0.557 |
| ACS | 0.629 | 0.542 | 0.557 | 1 |

Tablo 4 sonuçları en yüksek korelasyonun 0,72 ile ABD Dolar kuru ve Faiz arasında olduğu göstermektedir. Bunu 0,62 ile Açılan şirket sayısı ve ABD Dolar kuru ve açılan şirket sayısı takip etmektedir. Bağımsız değişkenler arasında 0,80'den daha yüksek korelasyonun önemli çoklu doğrusal bağlantıya neden olacağı ifade edilmektedir (Gujarati ve Porter, 2010). Buna göre değişkenler arasında çoklu doğrusal bağlantı olmadığı söylenebilir. Tablo 5'de değişkenlere ilişkin birim kök testi sonuçları sunulmuştur.

Tablo 5. Birim Kök Testi Sonuçları

| Kısaltma | ADF | | PP | | ADF | | PP | |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | Düzye I(0) | | | | Fark I(1) | | | |
| | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend |
| AFRK | -2,720 (0,074) | -3,928 (0,014) | -4,318 (0,000) | -5,469 (0,000) | -10,748 (0,000) | -10,735 (0,000) | -17,811 (0,000) | -17,937 (0,000) |
| AMRK | -6,158 (0,000) | -6,640 (0,000) | -4,122 (0,001) | -4,112 (0,008) | | | | |
| AVOEC | -9,203 (0,000) | -9,844 (0,000) | -4,201 (0,000) | -4,253 (0,005) | | | | |
| BADETO | -2,398 (0,145) | -2,909 (0,164) | -4,179 (0,001) | -4,157 (0,007) | -10,716 (0,000) | -10,656 (0,000) | -4,909 (0,000) | -4,897 (0,000) |
| BATAS | -3,967 (0,002) | -4,211 (0,006) | -3,967 (0,002) | -4,211 (0,006) | | | | |
| DASYA | -2,587 (0,099) | -3,798 (0,020) | -2,665 (0,083) | -3,696 (0,027) | -9,241 (0,000) | -9,186 (0,000) | -9,443 (0,000) | -9,373 (0,000) |
| DAVRU | -6,890 (0,000) | -7,949 (0,000) | -4,203 (0,001) | -4,276 (0,005) | | | | |
| DOECD | -5,135 (0,000) | -5,733 (0,000) | -3,543 (0,008) | -3,871 (0,017) | | | | |
| GASYA | -5,557 (0,000) | -5,742 (0,000) | -5,729 (0,000) | -5,917 (0,000) | | | | |

| | | | | | | | | | |
|------------------------------|--------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | GDASYA | -4,683 (0,000) | -5,460 (0,000) | -4,480 (0,000) | -5,294 (0,000) | | | | |
| Makroekonomik Değişkenler | DOL | -0,217 (0,972) | -2,952 (0,151) | 0,368 (0,980) | -2,352 (0,402) | -7,327 (0,000) | -7,368 (0,000) | -7,196 (0,000) | -7,225 (0,000) |
| | FAZ | -2,077 (0,254) | -3,155 (0,100) | -1,336 (0,609) | -2,360 (0,397) | -5,380 (0,000) | -5,627 (0,000) | -5,150 (0,000) | -5,118 (0,000) |
| | ISZ | -1,535 (0,511) | -2,480 (0,336) | -3,375 (0,031) | -3,514 (0,043) | -6,017 (0,000) | -6,061 (0,000) | -3,922 (0,002) | -3,963 (0,013) |
| | ACS | -2,041 (0,268) | -2,877 (0,174) | -3,528 (0,009) | -4,748 (0,001) | -15,991 (0,000) | -15,923 (0,000) | -15,688 (0,000) | -15,636 (0,000) |

Parantez içerisindeki değerler olasılık değerleridir. ADF istatistiğinin hesaplanmasında kullanılan gecikme için Schwartz Bilgi Kriterinden yararlanılmıştır. PP istatistiğinin hesaplanmasında kullanılan gecikme için Newey-West bant genişliği seçilmiştir.

Birim kök testi sonuçları incelendiğinde ülke gruplarına göre gelen turist sayısına ilişkin AFRK, BADETO ve DASYA değişkenlerinin düzeyde birim kök içerdiği, fark serisinde ise birim kökün giderildiği görülmektedir. Makroekonomik değişkenlerin ise tamamının birim kök içerdiği, fark serilerinde ise birim kökün giderildiği görülmektedir. Bu durumda AFRK, BADETO ve DASYA değişkenleri ile DOL, FAZ, ISZ ve ACS arasında uzun dönemli bir ilişkinin bulunup bulunmadığı Johansen eşbütünleşme analizi ile incelenebilir. Gerçekleştirilen eşbütünleşme analizi sonuçları Tablo 6'da incelenebilir.

Tablo 6. Eşbütünleşme Analizi Sonuçları

| Eşbütünleşme Modeli | Hipotez | Test Değerleri | | Kritik Değerler %5 | |
|-----------------------------------|---------|----------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | | λ_{iz} | $\lambda_{max} Öz$ | λ_{iz} | $\lambda_{max} Öz$ |
| AFRK = f{DOL, FAZ, ISZ, ACS} | r = 0 | 81,589* | 36,986* | 69,818 | 33,876 |
| | r ≤ 1 | 44,602 | 17,867 | 47,856 | 27,584 |
| | r ≤ 2 | 26,735 | 15,752 | 29,797 | 21,131 |
| | r ≤ 3 | 10,982 | 10,973 | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 4 | 0,008 | 0,0089 | 3,841 | 3,841 |
| BADETO = f{DOL, FAZ, ISZ, ACS} | r = 0 | 100,482* | 53,838* | 69,818 | 33,876 |
| | r ≤ 1 | 46,643 | 20,182 | 47,856 | 27,584 |
| | r ≤ 2 | 26,460 | 15,671 | 29,797 | 21,131 |
| | r ≤ 3 | 10,789 | 10,674 | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 4 | 0,115 | 0,115 | 3,841 | 3,841 |
| DASYA = f{DOL, FAZ, ISZ, ACS} | r = 0 | 87,563* | 44,562* | 69,818 | 33,876 |
| | r ≤ 1 | 43,001 | 22,283 | 47,856 | 27,584 |
| | r ≤ 2 | 20,717 | 15,396 | 29,797 | 21,131 |
| | r ≤ 3 | 5,321 | 5,273 | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 4 | 0,048 | 0,048 | 3,841 | 3,841 |

Gecikme uzunluğu için Schwartz Bilgi Kriterinden yararlanılmıştır.

Tablo 6 sonuçları AFRK, BADETO ve DASYA ülke gruplarından gelen turist sayılarının uzun dönemli olarak DOL, FAZ, ISZ ve ACS ile eşbütünleşik olduğunu, diğer bir ifade ile ilgili değişkenler arasında uzun dönemli bir ilişkinin olduğunu ortaya koymaktadır. Buna göre normalize edilmiş eşbütünleşme denklemi katsayıları Tablo 7'de incelenebilir.

Tablo 7. Normalize Edilmiş Eşbütünleşme Denklemi Katsayıları

| | DOL | FAZ | ISZ | ACS |
|--------|--------|--------|--------|-------|
| AFRK | -0,074 | 0,457 | -2,063 | 0,567 |
| BADETO | 0,165 | -0,489 | -0,317 | 0,826 |
| DASYA | 0,149 | 0,241 | -1,163 | 2,019 |

Tablo 7’de görülen normalize edilmiş eşbütünleşme denklemi katsayıları AFRK, BADETO ve DASYA ülke gruplarında benzer olarak işsizlik oranının gelen turist sayısı üzerinde negatif etkisinin olduğunu, açılan şirket sayısının ise pozitif etkisinin olduğunu ortaya koymaktadır. ABD Doları ve faiz ile ilgili etkiler ise ülke grupları arasında farklılaşmaktadır. AFRK, BADETO ve DASYA dışında kalan ve diğer ülke gruplarından gelen turist sayıları bağımlı değişken olmak üzere, fark (Δ) bağımsız değişkenler ve bağımlı değişkenin bir gecikmeli değeri $Y(-1)$ kullanılarak Model 2’yi ölçmeye yönelik gerçekleştirilen çoklu regresyon analizi sonuçları Tablo 8’de sunulmuştur.

Tablo 8. Çoklu Regresyon Analizi Sonuçları

| | C | Δ DOL | Δ FAZ | Δ ISZ | Δ ACS | $Y(-1)$ | R ² | DW | F |
|--------|------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|----------------|-------|-------------------|
| AMRK | 0,588 (0,026) | 0,588** (0,026) | -1,045 (0,129) | -3,057* (0,000) | -0,0001 (0,993) | 0,858* (0,000) | 0,69 | 1,815 | 39,765 (0,000) |
| AVOCD | 0,754 (0,024) | -0,720 (0,622) | -0,574 (0,491) | -3,504* (0,000) | -0,642* (0,006) | 0,874* (0,000) | 0,75 | 1,719 | 55,945 (0,000) |
| BATAS | 1,016 (0,005) | 0,682 (0,693) | -0,049 (0,929) | -0,260* (0,653) | -0,673* (0,000) | 0,809* (0,000) | 0,65 | 1,968 | 33,387 (0,000) |
| DAVRU | 0,366 (0,170) | -0,109 (0,854) | -0,043 (0,899) | -1,987* (0,000) | -0,425* (0,000) | 0,931* (0,000) | 0,80 | 1,600 | 74,900 (0,000) |
| DOECD | 0,314 (0,217) | 0,385 (0,698) | -0,733 (0,195) | -3,273* (0,000) | -0,099 (0,526) | 0,936* (0,000) | 0,80 | 1,620 | 72,464 (0,000) |
| GASYA | 2,579 (0,000) | 1,206 (0,364) | 0,591 (0,432) | -0,454 (0,054) | -0,176 (0,397) | 0,499* (0,000) | 0,27 | 2,210 | 6,76 (0,000) |
| GDASYA | 1,179 (0,000) | 1,441 (0,178) | -0,148 (0,805) | -2,389* (0,000) | -0,191 (0,253) | 0,720* (0,000) | 0,54 | 2,208 | 21,594 (0,000) |

Parantez içerisindeki değerler olasılık değerleridir. * ve ** sırasıyla %1 ve %5 önem seviyesinde anlamlılığı göstermektedir.

Tablo 8’de her bir ülke grubu için analizde kullanılan makroekonomik değişkenin katsayısı ile olasılık değeri, belirlilik katsayısı, Durbin Watson test istatistiği sonuçları ve F testi sonuçları görülebilir. Gerçekleştirilen analizlerin doğruluğunu incelemek amacıyla ilk olarak tahmin sonrası sonuçlarından Durbin Watson test istatistikleri tablo değerleri ile karşılaştırılmış ve analizler sonucunda otokorelasyona rastlanmamıştır. Değişen varyans (heteroscedasticity) ile ilgili olarak White düzeltmesi gerçekleştirilmiştir. F testi sonuçları ise tüm analizlerde kullanılan ekonometrik model kalıbın bir bütün olarak anlamlı olduğunu ortaya koymaktadır. Modellere ilişkin belirlilik katsayıları incelendiğinde R² nin 0,27 ile 0,80 arasında değiştiği görülmektedir.

Analizlerden edilen sonuçlar değişken bazında değerlendirildiğinde, ABD Doları’ndaki değişimin sadece Amerika ülke grubundan gelen turist sayısını istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif

etkilediği söylenebilir. Diğer ülke gruplarında ise, ABD Dolar kurunun anlamlı bir etkisine rastlanmamıştır. Faizlerdeki değişimin ise hiçbir ülke grubundan gelen turist sayısı üzerinde istatistiksel olarak anlamlı bir etkisine rastlanmamıştır. Diğer bir bağımsız değişken olan işsizlik oranındaki değişimin ise GASYA ülke grubu hariç tüm ülke gruplarında gelen turist sayısını negatif etkilediği Tablo 8'de görülmektedir. Ayrıca açılan şirket sayısındaki değişim katsayısı incelendiğinde ise sadece AVOECD, BATAS ve DAVRU ülke gruplarından gelen turist sayısı üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve negatif etkisinin olduğu söylenebilir. Analiz sonuçlarından elde edilen bir diğer bulgu da, her ülke grubu için bir önceki yılın gelen turist sayısının cari dönemi istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif etkilediği yönündedir.

5.BULGULARIN TARTIŞILMASI

Çalışma bulguları kuramsal olarak değerlendirildiğinde, ABD Dolar kurundaki değişimin etkili olduğu tek ülke grubu AMRK olup ilgili ülke grubu Arjantin, Brezilya, Dominik Cumhuriyeti, Ekvator, Kolombiya, Panama, Paraguay, Peru, Şili, Uruguay, Venezuela ve Diğer Amerika Ülkelerinden oluşmaktadır. Analiz dâhilinde ABD, TÜİK sınıflandırmasına göre diğer OECD ülkesi olarak değerlendirilmiştir. AMRK ülke grubu, ortalamada en düşük gelen turist sayısına sahip ülke grubudur. Analiz döneminde ABD Dolar kurundaki değişimin çoğunlukla negatif olduğu değerlendirildiğinde, etkinin yönü pozitif değil negatif olarak anlaşılmalıdır. Bu sonuç ilgili ülke grubundan gelen turistlerin ABD Dolar kurundaki değişim nedeniyle coğrafi olarak uzak sayılabilecek Türkiye'nin konumuna yönelik turizm faaliyetlerini azalttıkları şeklinde yorumlanabilir. Bununla birlikte AMRK ülke grubunun kişi başına gelir düzeyi ve kişi başına gelirden turizm faaliyetlerine ayrılan payının bu konuyla ilgili olarak değerlendirilmesi daha nitelikli sonuçlar verebilir. Ayrıca ABD Dolar kurunun diğer ülkelerden gelen turist sayısı üzerinde anlamlı bir etkisinin olmaması durumu ise turizm faaliyetinin önceden planlanan bir eylem olması ile açıklanabilir. Buna göre seyahat acenteleri tarafından daha önceden sabit fiyatlarla ve belirli marjlar ile alınan turizm servisleri yıl içerisinde önceden pazarlanmaktadır. Bu durumda yıl içerisinde döviz kuru değişiminin gelen turist sayıları üzerinde istatistiksel olarak anlamlı bir etkisi olmayabilir. Çalışmadan elde edilen bu sonuç ise benzer şekilde literatürdeki Eugenio-Martin vd. (2004), Mervar ve Payne (2007), Demirel vd. (2008) çalışmalarında da bulunmaktadır. İlgili çalışmalarda döviz kurlarındaki değişimler ile gelen turist sayıları arasında anlamlı bir ilişki tespit edilememiştir. Benzer şekilde, Lelwala ve Gunaratne (2008) çalışmasında da döviz kurunun kısa dönemde gelen turist sayısı üzerinde anlamlı bir etkisinin olmadığı ifade edilmektedir. Ayrıca Dinçer ve diğ. (2015) çalışmasında da Türkiye için döviz kuru ile turizm gelirleri arasında bir nedensellik ilişkisine rastlanmamıştır. Aynı sonuç, Pekmezci ve Bozkurt (2016) çalışmasında da bulunmakta olup ilgili çalışmada döviz kurunun turizm gelirlerini üzerinde anlamlı bir etkiye sahip olmadığı ifade

edilmektedir. Bu durum literatürdeki Song ve diğ. (2004) çalışmasında gelir esnekliği ile açıklanmaya çalışılmış olup, ilgili çalışmada turistlerin kısa dönemde uzun döneme kıyasla daha düşük gelir esnekliğine sahip oldukları ifade edilmektedir.

Faiz oranı ile ilgili elde edilen bulgular değerlendirildiğinde; her ne kadar Gu (1995) çalışmasında faiz oranlarındaki artışın turizm faaliyetleri üzerinde olası olumsuz etkisinden söz edilse de faiz değişimi çoğunlukla, fiyat istikrarını sağlamak ve döviz kuru istikrarını oluşturarak finansal istikrarı sürdürmek şeklinde yorumlanabilir. Faiz oranındaki değişimin doğrudan döviz kuru piyasası üzerinde istatistiksel olarak anlamlı bir etkisinin bulunmaması ise analiz döneminde faiz oranlarının sınırlı bir marjda değişmesi ve oynaklığının çok olmaması ile açıklanabilir.

İşsizlik oranındaki değişimin gelen turist sayısı üzerindeki etkisi değerlendirildiğinde, işsizlik oranı; ülke içi dinamiklere bağlı olarak makroekonomik bozulma veya iyileşmenin bir sonucu olarak ifade edilebilir. Çoğunlukla makroekonomik istikrarın bozulmasının bir sonucu olarak değerlendirilen işsizlik oranındaki artış, çalışma dönemi için GASYA hariç tüm ülke gruplarında gelen turist sayısının düşmesine neden olmaktadır. GASYA ülke grubunda ise istatistiksel olarak anlamlı bir etki saptanmamıştır. Yıldız (2011), Ünlüöner ve Şahin (2011) ve Şit (2016) çalışmalarında sektörel istihdamın turizm üzerindeki etkileri detaylı olarak incelenmiştir. İlgili çalışmalara göre, sektörde istihdamın artması beşeri sermaye birikimi ve nitelikli işgücünün artmasına neden olacaktır. Bu durumun ise gelen turist sayısı üzerinde olumlu etki oluşturması beklenebilir. Ayrıca bunun tam tersi de geçerlidir. Buna göre işsizlikteki artış, turizm sektöründe de işsizliğin artmasına neden olacaktır. Bu ise sektördeki kalifiye işgücünün azalmasına neden olabilecektir. Bu durumun ise gelen turist sayıları üzerinde olumsuz etkisi olabileceği düşünülmektedir.

Analizlerden elde edilen bir diğer bulguda açılan şirket sayısına ilişkin değişimin gelen turist sayılarını azalttığı yönündedir. Açılan şirket sayısı çok sofistike bir süreç ile değerlendirilebilir. Şirket kurulmasına yönelik düzenlemeler, teşvikler, ekonomik gelişmeler, siyasi dinamikler ve bu süreçlere ilişkin dolaylı etkiler açılan şirket sayısı üzerinde etkilidir. Açılan şirket sayısına ilişkin veriler değerlendirildiğinde açılan şirket sayılarındaki azalmaların ani ve fazla olduğu, artışların ise az ancak uzun vadede istikrarlı olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Buna göre açılan şirket sayısındaki düşüşlerin artışlara kıyasla, daha fazla olmasının bu sonuca neden olduğu düşünülmektedir.

Son olarak bir önceki yılın gelen turist sayısının cari dönemi pozitif etkilediği sonucu iki farklı şekilde yorumlanabilir. Buna göre Türk Turizmüne özgü ekonomik tatil anlayışı, nitelikli tesislerin varlığı, kalifiye çalışanlar ve tecrübe birikimi hangi ülke grubu olursa olsun dinamik bir etkiye neden olmakta ve gelen turist sayısında bir istikrar oluşturmaktadır. Diğer etki ise gelen ziyaretçilerin

dönüşlerinde olumlu görüşlerini çevrelerine anlatmaları neticesinde bir sonraki dönemde daha fazla gelen turiste neden olduğu yönündedir.

6.SONUÇ

Bu çalışmada farklı ülke gruplarından Türkiye'ye gelen turist sayılarının ABD Doları, faiz, işsizlik gibi makroekonomik faktörler ile açılan şirket sayısından etkilenip etkilenmediği incelenmeye çalışılmıştır. 2010–2017 arası dönemin aylık frekansta incelendiği çalışmada yöntem olarak eşbütünleşme ve çoklu regresyon analizi kullanılmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlar Afrika Ülkeleri, Bağımsız Devletler Topluluğu ve Doğu Asya ülkelerinden Türkiye'ye gelen turist sayılarının ABD Doları, faiz, işsizlik ve açılan şirket sayısı ile eşbütünleşik olduğunu, dolayısıyla ilgili makroekonomik faktörlerin uzun dönemli olarak ilgili ülkelere gelen turist sayılarını etkilediğini ortaya koymaktadır. Diğer ülke gruplarına yönelik gerçekleştirilen çoklu regresyon analizi sonuçları ise ABD Doları'ndaki değişimin sadece Amerika ülke grubundan gelen turist sayısını istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif etkilediğini ortaya koymaktadır. Amerika dışındaki ülke grupları için istatistiksel olarak anlamlı bir etkinin varlığına ulaşılamamıştır.

Döviz kurunun gelen turist sayısı üzerinde istatistiksel olarak anlamlı bir etkisinin olmadığı sonucu Lelwala ve Gunaratne (2008) çalışmasıyla da aynı yöndedir. İşsizlik oranındaki değişimin ise Güney Asya ülkelerinden gelen turist sayısı hariç diğer tüm ülke gruplarından gelen turist sayılarını negatif yönde etkilediği bulgusuna ulaşılmıştır. Bu sonuç ise teorik olarak Şit (2016) çalışmasında da ifade edilmektedir. Ayrıca çalışma sonucunda açılan şirket sayısındaki değişimin Avrupa OECD ülkeleri, Batı Asya ülkeleri ve Diğer Avrupa ülkelerinden gelen turist sayılarını negatif etkilediği tespit edilmiştir. Faiz oranındaki değişimin istatistiksel olarak anlamlı bir etkisine ise rastlanmamıştır.

KAYNAKÇA

- Aydın, A., Darıcı, B., Taşçı, H. M. (2015) “Uluslararası Turizm Talebini Etkileyen Ekonomik Faktörler: Türkiye Üzerine Bir Uygulama”. Erciyes Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, (45): 143177.
- Ben Aissa, S., and Goaid, M. (2017) “Performance of Tourism Destinations: Evidence from Tunisia”, Journal of Hospitality & Tourism Research, 41(7): 797-822.
- Crouch, G. I. (1994) “The Study of international Tourism Demand: A Survey of Practice”. Journal of Travel Research, 32(4): 41-55.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Demirel, B., Bozdağ, E. G. ve İnci, A. G. (2008) “Döviz Kurlarındaki Dalgalanmaların Gelen Turist Sayısına Etkisi: Türkiye Örneği”, DEÜ Ulusal İktisat Kongresi, İzmir.
- Dickey, D. A., and Fuller, W. A. (1981) “Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time-Series with a Unit Root”. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, 1057-1072.
- Dinçer M. Z., F. I. Dinçer ve M. Ustaoglu (2015) “Reel Effective Exchange Rate Volatilities Impact on Tourism Sector in Turkey: An Empirical Analysis of 2003-2014”, *Procedia Economics and Finance*, 23: 1000-1008.
- Eita, J. H., Jordaan, A. C., Jordaan, Y. (2011) “An Econometric Analysis of The Determinants Impacting On Businesses in The Tourism Industry”. *African Journal of Business Management*, 5(3): 666-675.
- Eugenio-Martin, J. L., Moralis, N. M. and Scarpa, R. (2004) “Tourism and Economic Growth in Latin American Countries: A Panel Data Approach”, *Nota Di Lavoro*, 26: 1-28.
- Gounopoulos, D., Petmezas, D., & Santamaria, D. (2012) “Forecasting Tourist Arrivals in Greece and the Impact of Macroeconomic Shocks from the Countries of Tourists’ Origin”. *Annals of Tourism Research*, 39(2): 641-666.
- Görmüş, Ş., Göçer, İ. (2010) “The Socio-Economic Determinant of Tourism Demand in Turkey: A Panel Data Approach”. *International Research Journal of Finance and Economics*, 55(1): 88-99.
- Gu, Z. (1995) “The Relationship between Interest Rate and Tourism Activities”. *International Journal of Hospitality Management*, 14(3-4): 239-243.
- Gujarati, D.N. and Porter, D.C. (2010) “Essentials of Econometrics”, 4th ed. New York: McGraw-Hill International.
- Güneş, E. ve Kabadayı, B. (2015) “Türkiye Turizm Talebini Açıklamaya Yönelik Bir Panel Çekim Modeli Analizi”. *Çukurova Üniversitesi İİBF Dergisi*. 19(2): 31-46.
- Ibrahim, M. A. (2011) “The Determinants of International Tourism Demand for Egypt: Panel Data Evidence”. *European Journal of Economics, Finance and Administrative Sciences*, 30: 50-58.
- Işık, C., Doğru, T., and Türk, E. S. (2018) “A Nexus of Linear and Non-Linear Relationships between Tourism Demand, Renewable Energy Consumption, and Economic Growth: Theory and Evidence”. *International Journal of Tourism Research*, 20(1): 38-49.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Jintranun, J., Sriboonchitta, S., Calkins, P., and Chaiboonsri, C. (2011) "Thailand's International Tourism Demand: Seasonal Panel Unit Roots and the Related Cointegration Model". *Review of Economics and Finance*, 1: 63-76.
- Johansen, S. (1988) "Statistical Analysis of Cointegration Vectors". *Journal of Economic Dynamics and Control*, 12(2-3): 231-254.
- Kaya, A. A. ve Canlı, B. (2013) "Türkiye'ye Yönelik Uluslararası Turizm Talebinin Belirleyenleri: Panel Veri Yaklaşımı". *Anadolu Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi*, 13(1): 43-54.
- Ketenci, N. (2009) "The ARDL Approach to Cointegration Analysis of Tourism Demand in Turkey with Greece as The Substitution Destination". *METU Studies in Development*, 36(2): 363-382.
- Kutlar, A. (2000). *Ekonometrik Zaman Serileri*. Gazi Kitabevi.
- Lelwala E.I., Gunaratne, L.H.P. (2008) "Modelling Tourism Demand Using Cointegration Analysis: A Case Study for Tourists Arriving from United Kingdom to Sri Lanka". *Tropical Agricultural Research*, 20:50-59.
- Mervar, A. and Payne, J. E. (2007) "Analysis of Foreign Tourism Demand for Croatian Destinations: Long-Run Elasticity Estimates", *Tourism Economics*, 13: 407-420.
- Narayan, P. K. (2004) "Economic Impact of Tourism on Fiji's Economy: Empirical Evidence from the Computable General Equilibrium Model", *Tourism Economics*, 10: 419-33.
- Ongan, S., Işık, C., & Özdemir, D. (2017) "The Effects of Real Exchange Rates and Income on International Tourism Demand for the USA from Some European Union Countries". *Economies*, 5(4): 51.
- Özcan, C. C. (2015) "Türkiye'de Turizm Gelirinin Makroekonomik Belirleyicileri: Panel Veri Analizi". *Ç.Ü. Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 24(1): 203-220.
- Paksoy, P., & Çolakoğlu, N. (2010) "Ekonomik Kriz Dönemlerinde Turizm ve Seyahat Endüstrisinin Tutumu". In *International Conference on Eurasian Economies* 344-350.
- Pekmezci, A., Bozkurt, K. (2016) "Döviz Kuru ve Ekonomik Büyüme: Türk Turizm Sektörü İçin Bir Analiz". *Süleyman Demirel Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 2 (24).
- Phillips, P. C., and Perron, P. (1988) "Testing for a Unit Root in Time Series Regression". *Biometrika*, 75(2): 335-346.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Qiong, Z., and Chen, D. (2018) "The Study on the Determinants of International Tourism Demand: The Case of Chinese Outbound Tourism to Japan". 5th International Conference on Business, Economics and Management (BUSEM 2018), Francis Academic Press, UK.

Song, H., Li G. ve Witt, S.F. (2004) "Modelling Tourism Demand: A Dynamic Linbear AIDS Approach". Journal of Travel Research, 43:141-150.

Surugiu, C., Leitão, N. C., Surugiu, M. R. (2011) "A Panel Data Modelling of International Tourism Demand: Evidences for Romania". Economic Research-Ekonomiska Istraživanja, 24(1): 134-145.

Şit, M., (2016) "Türkiye'de Turizm Sektörünün İstihdama Katkısı", Akademik Yaklaşımlar Dergisi, İlkbahar 7 (1).

Ünlüören, K., Şahin, S. Z. (2011) "Turizmde İstihdam", Elektronik Sosyal Bilimler Dergisi, Yaz-2011 10 (37): (001-025).

Walle, Y. M. (2010). "Tourist Flows and Its Determinants in Ethiopia", Ethiopian Development Research Institute, (No. 001).

Yıldız, Z., (2011), "Turizm Sektörünün Gelişimi ve İstihdam Üzerindeki Etkisi", Süleyman Demirel Üniversitesi Vizyoner Dergisi 3 (5): 54-71.

<https://www.wttc.org/-/media/files/reports/economic-impact-research/regions-2018/world2018.pdf>.

**REEL DÖVİZ KURUNUN FARKLI ÜLKE GRUPLARINDAN GELEN TURİST SAYILARI
ÜZERİNDEKİ ETKİSİNİN İNCELENMESİ: TÜRKİYE ÜZERİNE BİR UYGULAMA**

M.Oğuzhan İLBAN*

Sevgi SEZER**

M.Tahsin LİCELİ***

ÖZET

Bu çalışmanın amacı reel efektif döviz kurunun farklı ülke gruplarından Türkiye'ye gelen turist sayıları üzerinde etkisi olup olmadığını kısa ve uzun dönemde incelemektir. Bu bağlamda Ocak 2003–Aralık 2017 dönemi için aylık frekanstaki verilerden yararlanarak eşbütünleşme, hata düzeltme modeli ve hata düzeltme modeline bağlı nedensellik analizleri gerçekleştirilmiştir. Gerçekleştirilen analiz sonuçları, Doğu Asya ülke grubu istisna olmak üzere, uzun dönemde tüm ülke gruplarından Türkiye'ye gelen turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasındaki negatif yönlü nedensellik ilişkisini ortaya koymaktadır. Ancak kısa dönem için istatistiksel olarak anlamlı bir nedensellik ilişkisi olmadığını sonucuna varılmıştır. Diğer bir ifadeyle, kısa dönemde döviz kuru değişimlerinin gelen turist sayıları üzerinde herhangi bir etkisinin olmadığı tespit edilmiştir.

Anahtar Kelimeler: *Reel Döviz Kuru, Gelen Turist Sayıları, Türkiye*

**INVESTIGATING THE IMPACTS OF REAL EXCHANGE RATES ON THE NUMBER OF
TOURIST ARRIVALS TO TURKEY FROM DIFFERENT COUNTRY GROUPS : AN
APPLICATION ON TURKEY**

ABSTRACT

This study aims to determine whether or not the real effective exchange rates have any impact on the number of tourist arrivals to Turkey from different country groups either in the short- or the long-run. In this context; cointegration, error correction model and causality analyses related to error correction model are performed by using data in monthly frequency over the period January 2003-December 2017. The results of the analysis performed, with the exception of East Asia group, reveal the existence of a long-term negative causal relationship between the real effective exchange rates and the

* Prof.Dr., Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Gastronomi ve Mutfak Sanatları Bölüm Başkanı, e-mail: ilban@balikesir.edu.tr

** Dr.Öğr.Üyesi, Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Bankacılık ve Finans Bölümü, e-mail: sevgi.sezer@balikesir.edu.tr

*** Araş.Gör., Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Turizm İşletmeciliği ve Otelcilik Bölümü, e-mail: liceli@balikesir.edu.tr

number of tourist arrivals to Turkey from all country groups. Nonetheless, it is concluded that there is no statistically significant causal relationship in the short-run. In other words, it is determined that the exchange rate changes have no short-term impact on the number of tourists.

Keywords: *Real Exchange Rates, Number of Tourist Arrivals, Turkey*

1.GİRİŞ

Turizm; döviz gelirleri, yeni iş ve istihdam olanakları ve vergi gelirleri üzerindeki etkisi ile ekonomik büyüme ve kalkınmayı teşvik eden önemli kaynaklardan biridir (Farver, 1984; Göymen, 2000; Belloumi, 2010). Birçok gelişmekte olan ülke ekonomisi, sürdürülebilir bir ekonomik büyümeyi mümkün kılmak için dünyanın üçüncü büyük endüstrisi olarak anılan turizm alanında yatırımlar gerçekleştirmektedir (Sinclair, 1998). Turizm yarattığı katma değer ve gelişme potansiyeli ile ulusal ekonomilerde artan bir konuma sahip olan “dumansız endüstri” olarak bilinmektedir (Henderson, 2001; Leiper, 2008).

Devamlılık arz eden gelişme, genişleme ve çeşitlendirme ile turizm geçtiğimiz birkaç on yılda dünyadaki en büyük ve en hızlı büyüyen ekonomik sektörlerden biri ve en büyük hizmet sektörü haline gelmiştir. 2018 Yılı Dünya Turizmi Ekonomik Eğilimler Raporu'na göre, küresel anlamda gelen turist sayıları, 2017 yılında yaklaşık 11.9 milyar (dünya nüfusunun 1.6 katı) gibi rekor bir düzeye ulaşmıştır. Küresel turizm geliri, 2018 yılının üçüncü çeyreği itibariyle, küresel gayri safi yurtiçi hasılanın (GSYİH)% 6.8'ine denk gelecek biçimde 5.6 trilyon ABD Doları'na ulaşmıştır.

Küresel turist nüfusunun büyüme oranı ve toplam turizm gelirleri, küresel GSYİH büyüme oranından önemli ölçüde daha yüksektir. Turizm, sosyo-ekonomik kalkınmanın en önemli itici güçlerinden biri olan ihracat gelirleri, iş ve işletmelerin oluşturulması ve sosyo-ekonomik ilerlemeyi teşvik etmek amacıyla altyapı geliştirmesi ile sağlanmaktadır (Paramati et al., 2017). Bu da, turizmin bir ülkeye büyük iş fırsatları getirebileceğini ve ekonomik büyümesini destekleyebildiğini göstermektedir (Chiu ve Yeh, 2017). Sonuç olarak, turizmin ekonomik etkisi hükümetlerin artan ilgisini çektiğinden, son yıllarda turizm ve diğer makroekonomik değişkenler ile ilgili araştırmalar artmaktadır (De Vita ve Kyaw, 2013; Tang ve diğ., 2016; Stettler, 2017). Konuyla ilgili kuramsal ilişkileri ortaya koyan Webber (2001) çalışmasında turizmin, döviz kurundan etkilenme olasılığı olan belirli bir mal olduğunu belirtmiş ve bu etkinin teorik olarak iki farklı şekilde ortaya çıkabileceğini ileri sürmüştür. Buna göre ilk olarak, döviz kurundaki dalgalanmalar uluslararası turist varış noktası tercihini etkileyebilecektir çünkü turistler döviz kurunun daha uygun olduğu ülkeleri tercih etme eğilimindedir. İkinci olarak ise ziyaret edilen ülke para birimi değer kaybettiğinde, uluslararası turistlerin harcama yapmak için daha fazla parası vardır ve bu nedenle, kalış sürelerini uzatabilir ve harcamaları arttırabilirler (Crouch, 1993). Görünen

odur ki, bir ülkenin para birimine uygulana devalüasyon veya paranın serbest piyasada değer kaybı gelen turist sayısının artmasına yol açıyor gibi görünse de, bu konuyla ilgili araştırmalar kesin bir ilişkinin varlığını ortaya koyamamaktadır.

Bu çalışmanın amacı farklı ülke gruplarından Türkiye'ye gelen turist sayılarının kısa ve uzun dönemde döviz kuru değişiminden etkilenip etkilenmediğini ortaya koymaktır. Bu bağlamda çalışma beş bölümden oluşmaktadır. İlk bölümde konuya giriş yapılmış ikinci bölümde ise konuyla ilgili literatüre yer verilmiştir. Üçüncü bölümde analizlerde kullanılan veri ve yöntem açıklanmıştır. Dördüncü bölümde ise elde edilen bulgulara yer verilmiştir. Son bölüm ise genel bir değerlendirmeden oluşmaktadır.

2.KONUyla İLGİLİ ÇALIŞMALAR

Döviz kuru ile turizm arasındaki ilişkiyi inceleyen çok sayıda çalışma mevcuttur. Ancak bu çalışmada uygulanan metodolojiye benzer nitelikte uygulama gerçekleştiren veya farklı ülkelerden gelen turist sayılarını inceleyen çalışma sayısı görece olarak sınırlıdır. Bu bağlamda incelenen çeşitli çalışmalara aşağıda yer verilmiştir.

Bahar (2007) çalışmasında, 1980 sonrası Türkiye'de yaşanan devalüasyonların turizm sektörü üzerinde herhangi bir olumlu veya olumsuz etki yaratıp yaratmadığını incelenmiştir. Bu amaçla, gelen turist sayısının devalüasyonlardan etkilenip etkilenmediği; ülkeye gelen turist sayısı, Amerikan Doları ve Alman Mark'ından oluşan bir para birimi sepeti ve devalüasyon uygulanan yıllar için bir kukla değişken kullanılarak 1980-2005 yılları arasında analiz edilmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar ülkedeki devalüasyonların gelen turist sayısını artırdığını ortaya koymaktadır.

Demirel ve diğ. (2008) çalışmasında; Türkiye'ye en çok turist gönderen ülkeler arasında bulunan ABD, Almanya, Fransa ve İngiltere'den gelen turist sayısı üzerinde döviz kuru dalgalanmalarının olası etkisi 1994-2006 yılları arasındaki dönem için incelenmiştir. Çalışmanın üçer aylık verileri TCMB ve IMF veritabanından elde edilmiştir. Elde edilen sonuçlara göre; Fransa için reel döviz kuru değişiklikleri, ülkeye gelen turist sayısı üzerinde olumsuz etki yaratmıştır. Reel döviz kuru belirsizliği açısından incelendiğinde, Fransa dışındaki ülkelerde reel döviz kuru belirsizliklerinin, turist sayısının üzerinde herhangi bir etkisi olmadığı sonucuna ulaşılmıştır.

Kuo ve diğ. (2010) çalışmasının temel amacı, Asya ve Pasifik ülkelerindeki uluslararası turizm talebi ile döviz kuru arasındaki bağımlılık yapısının toplu veri ölçümlerini aylık verilere dayanarak Copula yöntemi yardımıyla incelemektir. Çalışmada kullanılan veriler Turizm Bürosu online istatistik veritabanlarından elde edilen sekiz Asya ülkesinin (Japonya, Çin, Kore, Tayvan, Hong Kong, Singapur, Malezya ve Tayland) turist sayıları ve döviz kurlarının Ocak 2001- Temmuz 2007 dönemi için aylık

verilerinden oluşmaktadır. Çalışmadan elde edilen ampirik sonuçlara göre, uluslararası turist sayısı ve döviz kuru arasındaki negatif ilişki olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Ayrıca yerel paranın değer kazanmasının turizm talebi üzerindeki etkisinin, para birimindeki değer kaybından daha fazla olduğu ortaya konulmuştur.

Quadri ve Zheng (2010) çalışmasında döviz kurlarının İtalya'ya gelen uluslararası turist sayısı üzerindeki etkisi incelenmiştir. İlgili çalışmada 19 ayrı ülkeden İtalya'ya gelen turist sayıları ile döviz kuru arasındaki ilişki 2004-2009 yılları arasındaki dönemi için regresyon analizi yardımıyla incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, döviz kurlarının gelen turist sayısı üzerindeki etkisinin sınırlı olduğunu ve incelenen 19 ülkeden sadece 8'inde anlamlı sonuçlara ulaşıldığını ortaya koymaktadır. Bu sonuç döviz kurlarının evrensel anlamda turizm talebini etkilemediğini ortaya koymaktadır.

Uğuz ve Topbaş (2011) çalışmasında, Türkiye için döviz kuru oynaklığı ve turizm talebi arasındaki ilişki, 1990-2010 dönemine ait aylık turizm gelirleri ve döviz kuru verileri kullanılarak incelenmiştir. İlgili çalışmada EGARCH modelinin yardımıyla aylık döviz kuru oynaklığı tespit edilmiş ve Johansen eşbütünleşme analizi çerçevesinde döviz kuru oynaklığı ve turizm talebi etkileşimi incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, turizm talebinin uzun dönemde döviz kuru ve döviz kuru oynaklığı ile istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki içinde olduğu göstermektedir.

Chang ve McAleer (2012) çalışmasında Tayvan için önde gelen iki turizm ülkesi olan Japonya ve ABD'den gelen turist sayısı ve turizm geliri ile Yen/Yeni Tayvan Doları, ABD Doları/Yeni Tayvan Doları kurları arasındaki ilişki incelenmiştir. İlgili çalışmada döviz kuru oynaklığının GARCH ve EGARCH modellemesi için 1 Ocak 1990 - 31 Aralık 2008 arası döneme ait günlük verilerden yararlanılmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlara göre, döviz kuru ve döviz kuru oynaklığı etkilerinin farklı olduğu tespit edilmiştir. Ayrıca döviz kurundaki artışların Tayvan'a gelen turist sayısı üzerinde olumsuz etkiye sahip olduğu ancak, döviz kuru oynaklığının Tayvan'a gelen turistler üzerinde olumlu veya olumsuz etkileri olabileceği sonucuna ulaşılmıştır.

Tang (2013) çalışmasında 1974-2009 arası dönem için Malezya'daki reel turizm gelirleri, reel gelir ve reel döviz kurları arasındaki dinamik ilişkiyi analiz etmek amacıyla sınır testi yaklaşımı ve hata düzeltme modellemesi uygulanmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, değişkenler arasında uzun dönemli bir ilişki olduğunu ortaya koymaktadır. Kısa dönemde ise, reel turizm gelirleri ile reel gelir arasında Granger nedensellik bulunmazken, uzun dönemde iki yönlü bir nedensellik olduğu tespit edilmiştir. Çalışmada ayrıca, hem kısa hem de uzun dönemde reel döviz kurlarından reel turizm gelirlerine doğru tek yönlü nedensellik bulunmuştur.

Agiomirgianakis ve diğ. (2014) çalışmasında, 1994-2012 dönemi için döviz kuru volatilitésinin Türkiye'ye gelen turist sayısı üzerindeki etkileri incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, döviz kurundaki dalgalanma ve turist girişleri arasında negatif bir ilişki olduğunu ortaya koymaktadır. Ayrıca nispeten pahalı yerler ile alternatif lokasyonlar arasındaki rekabet göz önüne alındığında, nispeten pahalı yerlerin turistleri caydırdığını gösteren nispi fiyat oranının ülkeye turist girişine olumsuz etkisi olduğu tespit edilmiştir.

Agiomirgianakis ve diğ. (2015) çalışmasında iki AB üyesi ülke olan İngiltere ve İsveç arasındaki turizm akışları ve döviz kuru oynaklığı arasındaki ilişki 1990-2012 yılları arasındaki dönem için incelenmiştir. Çalışmada eşbütünleşme ve hata düzeltme modelleri uygulanmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, İngiltere ve İsveç'e yönelik turist akışları ile döviz kurundaki dalgalanma arasında negatif bir ilişki olduğunu ve hem nispi fiyat oranının hem de reel milli gelirin turist akışları üzerinde etkisi olduğunu ortaya koymaktadır.

Samırkaş ve Samırkaş (2015) çalışmasında 2003-2012 dönemi için Johansen eşbütünleşme testi ve Granger nedensellik testi kullanılarak Türkiye'de döviz kuru ve turizm talebi arasındaki ilişki incelenmiştir. Çalışma sonucunda turist başına turizm gelirleri ve reel döviz kuru arasında uzun vadeli ilişki bulunmaktadır. Ayrıca reel döviz kuru ve Türkiye'ye gelen turist başına turizm geliri arasında nedensellik ilişkisi mevcuttur. Çalışmada özellikle İngiliz Sterlin'i ile İngiltere'den gelen turist sayısı arasında önemli bir eşbütünleşme ilişkisinin varlığı tespit edilmiştir.

Kiang ve diğ. (2015) çalışmasında, Ocak 2007- Mart 2015 dönemi arasında döviz kurunun; Tayland turist sayısı, toplam 14 ülkedeki (Çin, Hong Kong, Japonya, G.Kore, Tayvan ve 9 Güney Asya ülkesi) döviz kurları ve gelen turist sayısı arasındaki ilişki Çoklu Regresyon ve Panel Veri Analiz yöntemiyle incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar gecikmeli turist sayısının ve döviz kurlarının gelen turist sayısı ile anlamlı bir ilişkisi olduğunu ortaya koymaktadır. Ayrıca döviz kurunun Tayland'a gelen turist sayısını etkilediği sonucuna ulaşılmıştır. İlgili çalışmada her bir ülke ayrı ayrı incelenerek, döviz kurunun belirli ülkeler üzerinde etkisi olduğu sonucuna varılmıştır. Çalışmada döviz kurunun gelen turist sayısını etkilemediği ülkeler için bir saptama geliştirilmiştir. Buna göre turistlerin önceden gezileri planlaması yaygındır, bu nedenle döviz kuru her zaman mevcut gelen turist sayılarını etkilemeyebilir.

Bozkurt ve Pekmezci (2015) çalışmasında Türk turizm sektörüne yönelik talep ve döviz kuru şokları arasındaki ilişki teorik ve ampirik olarak analiz edilmiştir. Bu bağlamda, turist sayısının standart hatası ve standart döviz kuru hatası, Ocak 1996 ve Eylül 2012 için talep şoku ve döviz kuru şokunun bir

göstergesi olarak kullanılmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlar turizm talebi şoku ile döviz kuru şoku arasında negatif uzun vadeli bir ilişki olduğu sonucunu ortaya koymaktadır.

Wang ve Tang (2018) çalışmasında 2008-2014 dönemi için Pekin’de gelen turist sayısının Yuan kuru oynaklığından etkilenip etkilenmediği incelenmiştir. Çalışmada eşbütünleşme testi ve Granger nedensellik testi kullanılarak gerçekleştirilen analiz sonuçları, Yuan’ın değer kazanmasının gelen turist sayısı üzerindeki olumsuz etkisinin 2011’in sonundan itibaren geliştiği göstermektedir. Ayrıca Yuan kuru oynaklığının, Pekin’in gelen turist sayısı üzerinde gecikmeli bir etkiye sahip olduğu ifade edilmiştir.

3. VERİ VE YÖNTEM

Analizlerde kullanılan verilerden ilki Türkiye İstatistik Kurumu (TÜİK) turizm istatistikleri, turizm ve sınır istatistikleri listesinden, giriş çıkış yapan ziyaretçiler içerisinde yer alan, ülke gruplarına göre giriş yapan turist istatistiklerinden derlenmiştir. Ülke gruplarına göre giriş yapan turist istatistiklerine ilişkin hesaplamaların ulaşılabilir olduğu ilk dönem Ocak 1996’dır. TÜİK tasnifine göre ilgili ülke grupları ve örnekleme yer alan ülkeler ve ilgili gruplar için kullanılacak kısaltmalar Tablo 1’de görülebilir.

Tablo 1. Analizlere Dâhil Edilen Ülke Grupları ve Kapsamındaki Ülkeler

| Ülke Grubu | Kısaltma | Ülkeler |
|------------------------------|----------|--|
| Afrika Ülkeleri | AFRK | Cezayir, Fas, Güney Afrika Cumhuriyeti, Kenya, Libya, Mısır, Nijerya, Senegal, Sudan, Tunus, Diğer Afrika Ülkeleri. |
| Amerika Ülkeleri | AMRK | Arjantin, Brezilya, Dominik Cumhuriyeti, Ekvator, Kolombiya, Panama, Paraguay, Peru, Şili, Uruguay, Venezuela, Diğer Amerika Ülkeleri. |
| Avrupa OECD Ülkeleri | AVOEC | Almanya, Avusturya, Belçika, Çek Cumhuriyeti, Danimarka, Finlandiya, Fransa, Hollanda, İngiltere, İrlanda, İspanya, İsveç, İsviçre, İtalya, İzlanda, Lüksemburg, Macaristan, Norveç, Polonya, Portekiz, Slovakya, Yunanistan |
| Bağımsız Devletler Topluluğu | BADETO | Azerbaycan, Beyaz Rusya, Ermenistan, Gürcistan, Kazakistan, Kırgızistan, Moldova Cumhuriyeti, Özbekistan, Rusya Federasyonu, Tacikistan, Türkmenistan, Ukrayna. |
| Batı Asya Ülkeleri | BATAS | Birleşik Arap Emirlikleri, Bahreyn, Filistin, Irak, İsrail, Katar, Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti, Kuveyt, Lübnan, Suriye, Suudi Arabistan, Umman, Ürdün, Yemen. |
| Diğer Avrupa Ülkeleri | DAVRU | Arnavutluk, Bosna Hersek, Bulgaristan, Estonya, Hırvatistan, Letonya, Litvanya, Makedonya, Romanya, Sırbistan, Slovenya, Diğer Avrupa Ülkeleri. |
| Diğer OECD Ülkeleri | DOECD | ABD, Avustralya, Japonya, Kanada, Kore, Meksika, Yeni Zelanda. |
| Doğu Asya Ülkeleri | DASYA | Çin, Hong Kong, Diğer Doğu Asya Ülkeleri. |
| Güney Asya Ülkeleri | GAYSA | Afganistan, Bangladeş, Hindistan, İran, Pakistan, Diğer Güney Asya Ülkeleri. |
| Güneydoğu Asya Ülkeleri | GDASYA | Endonezya, Filipinler, Malezya, Singapur, Tayland, Diğer Güneydoğu Asya Ülkeleri. |

Analizlerde kullanılacak bir diğer veri olan reel efektif döviz kuru endeksi, nominal efektif döviz kuru kullanılarak hesaplanmaktadır. Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası (TCMB) tanımına göre Nominal efektif döviz kuru, Türkiye'nin dış ticaretinde önemli paya sahip ülkelerin para birimlerinden oluşan sepete göre, Türk Lirası (TL)'nin ağırlıklı ortalama değeridir. Ağırlıklar ikili ticaret akımları kullanılarak belirlenmektedir. Reel efektif döviz kuru ise nominal efektif döviz kurundaki nispi fiyat etkileri arındırılarak elde edilmektedir. TCMB tarafından hesaplanan reel efektif döviz kuru endeksleri ülkemiz fiyat düzeyinin dış ticaret yapılan ülkelerin fiyat düzeylerine oranının ağırlıklı geometrik ortalaması alınarak hesaplanmaktadır (<http://www.tcmb.gov.tr>). İlgili kurun hesaplanma yöntemi aşağıdaki gibi ifade edilebilir:

$$REK = \prod_{i=1}^N \left[\frac{P_{TUR}}{P_i * e_{i,TUR}} \right]^{w_i} \quad (1)$$

Denklemden yer alan w_i "i" ülkesinin Türkiye'nin reel efektif döviz kuru endeksindeki ağırlığını, P_{TUR} Türkiye'nin fiyat endeksini, P_i "i" ülkesinin fiyat endeksini, $e_{i,TUR}$ "i" ülkesinin parasının TL cinsinden kur değerini ve N ülke sayısını göstermekte olup hesaplamalara 44 ülke dâhil edilmektedir. Denklemden reel efektif kurun artışı TL'nin reel olarak değer kazandığını, diğer bir anlatımla Türk mallarının yabancı mallar cinsinden fiyatının arttığını göstermektedir. Reel efektif döviz kuru endeksi verisinin hesaplanmaya başlandığı ilk dönem Ocak 2003'tür.

Mevcut veri seti ve ulaşılabilen tüm bilgiler değerlendirildiğinde bu çalışmada çeşitli kısıtlar bulunmaktadır. Buna göre ilk kısıt, veri yapısından kaynaklı olarak analizler, ülkeler üzerine değil, ülke grupları üzerine gerçekleştirilmiş ve ilgili ülke grupları ise TÜİK tarafından belirlenmiştir. Ayrıca TÜİK sınıflandırmasında bulunan ancak verisinin kesintili olması ve diğer verilere kıyasla oldukça düşük olması nedeniyle Milliyetsizler ve Okyanusya ülkeleri analizlere dâhil edilmemiştir. Bunun dışında çalışma dönemi en geniş veri seti ile gerçekleştirilmek amaçlanmıştır. Buna göre her iki veri setinin de ortak olarak ulaşılabildiği ilk dönem Ocak 2003'tür. Ayrıca tam bir yıllık döngüyü kapsamı açısından analizin son dönemi olarak Aralık 2017 tarihi belirlenmiştir. Buna göre aylık frekansta gerçekleştirilen analiz için çalışma dönemi Ocak 2003–Aralık 2017 olarak belirlenmiş olup diğer dönemler analizlere dâhil edilememiştir.

Zaman serisi analizlerinde ilk analiz genellikle serilerin durağanlığının incelenmesidir. Bir zaman serisinin durağan olması, sabit bir ortalama, sabit bir varyans ve gecikme mesafesine bağlı kovaryansa sahip olması durumudur. Nelson ve Plosser (1982) çalışması çoğu zaman serisinin durağan olmadığını ortaya koymaktadır. Zaman serisi kullanarak oluşturulan regresyonda durağan olmayan serilerin kullanılması, yapılan tahminde sahte regresyonu ortaya çıkarabilir (Kutlar, 2000:252). Dickey ve Fuller (1981) çalışması ve sonrasında gerçekleştirilen Phillips ve Perron (1988) çalışmasıyla zaman serilerinin

durağanlığını test edebilen metodolojiler geliştirilmiştir. Fuller (1976), Dickey ve Fuller (1979) ve Dickey ve Fuller (1981) çalışması ile önerilen Genişletilmiş Dickey Fuller (ADF) testi otoregresif süreçler ile sabit terimsiz, sabit terimli, trendli ve sabit terimli ekonometrik kalıplar için birim kökün varlığını incelemektedir.

ADF testi ile serinin birim kök içerdiği (durağan olmadığı) boş hipotezinin, birim kök içermediği (durağan olduğu) alternatif hipotezine göre sınaması gerçekleştirilir. Genişletilmiş Dickey Fuller testi sınama kalıplarına gecikmeli değerler ekleyerek Dickey Fuller testini otokorelasyon problemine karşı düzeltmiştir. Phillips-Perron birim kök testi ise hata teriminin zayıf derecede bağımlı olmasına ve heterojen olarak dağılmasına izin vermektedir (Enders, 2004:229). Bundan dolayı her iki testin birbirini tamamlar nitelikte olduğu söylenebilir.

Bağımlı ve bağımsız değişkenlerin aynı anda birim kök içermesi ve aynı dereceden fark alınarak ilgili serilerden birim kökün giderilmesi eşbütünleşmenin incelenmesini gerektirir. Değişkenlerin eşbütünleşik olması uzun dönemli bir ilişkinin varlığını ortaya koymaktadır. Diğer bir ifade ile durağan olmayan zaman serilerinin doğrusal bileşimi durağan olabilmektedir. Eşbütünleşme analizi ile değişkenlere ait seriler durağan olmasalar bile bu serilerin durağan bir kombinasyonunun var olabileceği ve varsa bunun belirlenebileceği ifade edilmektedir (Tarı, 2010: 415).

Buna göre eşbütünleşik serilerin uzun dönemde birlikte hareket ettiği söylenebilir. Zaman serileri arasındaki eşbütünleşme ilişkisini belirlemek için Engle ve Granger (1987), Johansen (1988), Johansen ve Juselius (1990) çalışmalarıyla geliştirilen çeşitli yöntemler bulunmaktadır. Johansen (1988) çalışması eşbütünleşme ilişkisinin tespit edilmesi için en çok olabilirlik tahmini ile eşbütünleşme vektörlerinin varlığını araştırılmaktadır. İlgili yöntemde iz testi ve maksimum öz değer testi olmak üzere iki farklı testten yararlanılmakta ve hesaplanan istatistiklerin kritik değerlerle karşılaştırılması yapılarak eşbütünleşme ilişkisinin bulunup bulunmadığına karar verilmektedir. Eşbütünleşme ilişkisinin varlığı altında Granger (1987) çalışması seriler arasında bir nedensellik ilişkisinin bulunmadığının incelenmesi için hata düzeltme modelini önermektedir. ECT eşbütünleşme ilişkisinden oluşan kalıntıları ifade etmek üzere hata düzeltme modeli aşağıdaki gibi ifade edilebilir.

$$\Delta X_t = \alpha_1 + \sum_{i=1}^m \beta_{1i} \Delta Y_{t-1} + \sum_{i=1}^n \gamma_{1i} \Delta X_{t-i} + \sum_{i=1}^r \delta_{1i} ECT_{r,t-1} + u_t \quad (2)$$

$$\Delta Y_t = \alpha_1 + \sum_{i=1}^m \beta_{1i} \Delta X_{t-1} + \sum_{i=1}^n \gamma_{1i} \Delta Y_{t-i} + \sum_{i=1}^r \delta_{1i} ECT_{r,t-1} + u_t \quad (3)$$

İki yönlü olarak incelenebilen eşbütünleşme ilişkisinde ECT'lerin negatif ve anlamlı olması hata düzeltme modelinin işlediğini göstermektedir (Tarı, 2010:416). Eşbütünleşme ilişkisi iki yönlü olarak

ifade edilse de reel efektif döviz kuru ve gelen turist sayıları arasındaki ilişki kuramsal olarak tek yönlüdür. Diğer bir ifadeyle döviz kuru üzerinde etkili olan faktörler çok çeşitli olabilir. Bundan dolayı bu çalışmada hata düzeltme modeli tek yönlü olarak incelenmiş reel efektif döviz kuru endeksinin gelen turist sayıları üzerindeki etkisi ve aynı yöndeki nedensellik incelenmiştir.

4.BULGULAR

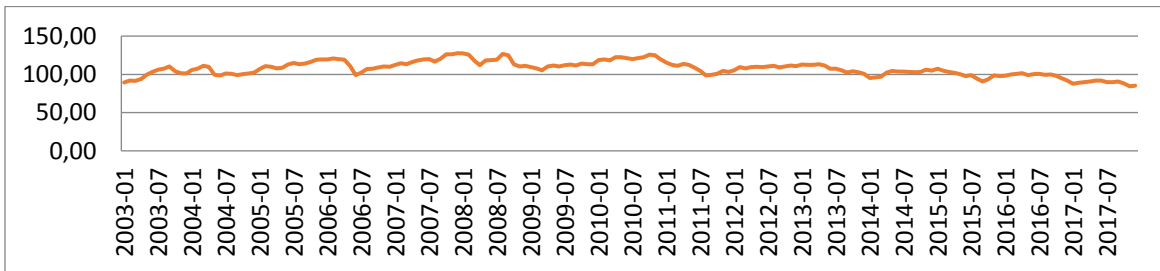
Turizm sektörünün çalışma dönemindeki örnekleme bağlı bir değerlendirmesi için hesaplanan tanımlayıcı istatistikler Tablo 2’de verilmiştir. Tablo 2 değerlendirildiğinde aylık ortalama itibariyle en çok turistin Avrupa OECD ülkelerinden geldiği görülmektedir. Ortalamada 1.079.376 gelen turist sayısını 499.859 ile Bağımsız Devlet Topluluğu takip etmektedir. En düşük ortalama gelen turist sayısına sahip ülke topluluğu ise Güney Doğu Asya ülke grubuna aittir.

Tablo 2. Turizm Verisine Ait Tanımlayıcı İstatistikler

| | Maksimum | Minimum | Ortalama | Std. Sap. | Gözlem Sayısı |
|--------|-----------|---------|-----------|-----------|--|
| AFRK | 125.010 | 6.949 | 41.188 | 24.392 | 2003 – 2017 15 Yıl * 12 Ay 180 Dönem |
| AMRK | 36.089 | 670 | 12.692 | 8.620 | |
| AVOCD | 2.724.946 | 170.525 | 1.079.376 | 681.937 | |
| BADETO | 1.651.987 | 45.697 | 499.859 | 366.680 | |
| BATAS | 634.336 | 20.643 | 170.345 | 106.909 | |
| DASYA | 47.616 | 1.392 | 13.036 | 9.534 | |
| DAVRU | 412.124 | 78.979 | 209.612 | 71.270 | |
| DOECD | 208.902 | 18.171 | 96.605 | 52.853 | |
| GASYA | 361.756 | 16.775 | 122.428 | 63.913 | |
| GDASYA | 41.744 | 1.045 | 12.421 | 7.718 | |

Analizlerde kullanılan diğer değişken olan reel efektif döviz kurunun Ocak 2003 – Aralık 2017 dönemleri arası gelişimi analitik olarak Grafik 1’de görülebilir. Grafik 1 incelendiğinde ilgili endeks verisinin 2010 yılından sonra düşü eğiliminde olduğu, en yüksek olduğu döneme ise 127,63 ile 2007 yılının 12. ayında ulaştığı söylenebilir. 2017 yılının Aralık ayı itibariyle ilgili seri en düşük düzeyine gerilemiştir. Döviz kuru paritesinden farklı olarak reel efektif döviz kuru endeksinin azalması TL’nin değer kaybettiği şeklinde yorumlanmaktadır.

Grafik 1. Reel Efektif Döviz Kuru Endeksi



Farklı bölgelerden gelen turist sayısı ile reel efektif döviz kuru endeksi arasında kısa ve/veya uzun dönemli bir ilişkinin olup olmadığını incelemek amacıyla ilk olarak analize dâhil edilecek serilerin logaritması alınmıştır. Logaritması alınan serilere ait tanımlayıcı istatistikler Tablo 3'de incelenebilir.

Tablo 3. Analizlerde Kullanılan Değişkenlere Ait Tanımlayıcı İstatistikler

| | Maksimum | Minimum | Ortalama | Std. Sap. |
|--------|----------|---------|----------|-----------|
| AFRK | 5,097 | 3,842 | 4,533 | 0,276 |
| AMRK | 4,557 | 2,826 | 3,977 | 0,370 |
| AVOEC | 6,435 | 5,232 | 5,931 | 0,313 |
| BADETO | 6,218 | 4,660 | 5,583 | 0,326 |
| BATAS | 5,802 | 4,315 | 5,147 | 0,284 |
| DASYA | 4,678 | 3,144 | 4,008 | 0,310 |
| DAVRU | 5,615 | 4,898 | 5,296 | 0,152 |
| DOECD | 5,320 | 4,259 | 4,913 | 0,261 |
| GASYA | 5,558 | 4,225 | 5,020 | 0,261 |
| GDASYA | 4,621 | 3,019 | 3,997 | 0,312 |
| REDK* | 2,106 | 1,926 | 2,029 | 0,040 |

* Reel Efektif Döviz Kuru Endeksi

Analizlerde kullanılan değişkenler düzey ve fark seviyesinde gerçekleştirilen sabitli (*individual intercept*) ile sabitli ve trendli (*individual intercept and trend*) birim kök sınaması sonuçları Tablo 4'de görülebilir.

Tablo 4. Birim Kök Sınaması Sonuçları

| | ADF | | PP | | ADF | | PP | |
|--------|---------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | Düzyen I(0) | | | | Fark I(1) | | | |
| | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend |
| AFRK | -1,083 (0,722) | -2,012 (0,590) | -3,280** (0,017) | -7,960* (0,000) | -3,618* (0,006) | -3,640** (0,029) | -19,413* (0,000) | -19,370* (0,000) |
| AMRK | -3,177** (0,023) | -2,153 (0,511) | -4,394* (0,000) | -5,833* (0,000) | -4,499* (0,000) | -5,138* (0,000) | -14,958* (0,000) | -14,948* (0,000) |
| AVOEC | -2,175 (0,216) | -1,795 (0,702) | -5,443* (0,000) | -5,415* (0,000) | -3,056** (0,032) | -3,587** (0,018) | -8,795* (0,000) | -8,780* (0,000) |
| BADETO | -1,106 (0,712) | -2,502 (0,326) | -4,520* (0,000) | -4,191* (0,005) | -4,063* (0,001) | -3,977** (0,011) | -6,991* (0,000) | -6,974* (0,000) |
| BATAS | -1,385 (0,588) | -2,383 (0,387) | -3,822* (0,003) | -5,850* (0,000) | -3,751* (0,004) | -3,743** (0,022) | -12,038* (0,000) | -12,022* (0,000) |
| DASYA | -2,763 (0,065) | -6,702* (0,000) | -2,485 (0,120) | -6,427* (0,000) | -3,709* (0,004) | -3,662** (0,027) | -37,414* (0,000) | -37,268* (0,000) |
| DAVRU | -1,473 (0,579) | 3,454** (0,047) | -4,761* (0,000) | -5,704* (0,000) | -3,419** (0,011) | -3,565** (0,035) | -9,866* (0,000) | -9,847* (0,000) |
| DOECD | -2,139 (0,229) | -0,408 (0,986) | -4,204* (0,000) | -4,162* (0,006) | -3,867* (0,002) | 5,161* (0,000) | -9,323* (0,000) | -9,598* (0,000) |
| GASYA | -1,617 | -2,473 | -5,419* (0,000) | -7,729* (0,000) | -4,712* (0,000) | -4,715* (0,000) | -23,401* (0,000) | -23,362* (0,000) |

| | | | | | | | | |
|--------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | (0,471) | (0,340) | (0,000) | (0,000) | (0,000) | (0,000) | (0,000) | (0,000) |
| GDASYA | -1,397 (0,582) | -1,857 (0,671) | -4,164* (0,001) | -7,816* (0,000) | -5,169* (0,000) | -5,184* (0,000) | -24,770* (0,000) | -25,535* (0,000) |
| REDK | -1,939 (0,313) | -3,118 (0,105) | -2,095 (0,246) | -3,005 (0,133) | -10,134* (0,000) | -10,340* (0,000) | -10,017* (0,000) | -10,138* (0,000) |

Parantez içerisindeki değerler olasılık değerleridir. * ve ** sırasıyla %1 ve %5 seviyesinde anlamlılığı göstermektedir. ADF istatistiğinin hesaplanmasında kullanılan gecikme için Schwartz Bilgi Kriterinden yararlanılmıştır. PP istatistiğinin hesaplanmasında kullanılan gecikme için Newey-West bant genişliği seçilmiştir.

Tablo 4 sonuçları tüm seriler için düzeyde birim kökün varlığını ortaya koymaktadır. Ayrıca fark seviyesinde ise birim kökün varlığına ilişkin bulgulara ulaşılamamıştır. Bu durumda tüm seriler 1. dereceden bütünlüktür I(1). Bu bulgu ülke gruplarına göre giriş yapan turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasında eşbütünlüşme ilişkisi olabileceğini ortaya koymaktadır.

Eşbütünlüşme ilişkisinin varlığını sınamak için Johansen (1988) çalışması ile geliştirilen eşbütünlüşme sınaması gerçekleştirilmiştir. Eşbütünlüşme ilişkisi lineer deterministik trend ile sabitin var olduğu ve olmadığı modeller için uygun gecikme seviyesinde ayrı ayrı sınanmıştır. Elde edilen sonuçlar Tablo 5'de verilmiş olup eşbütünlüşme modelleri ile optimal gecikme uzunlukları kullanılan değişkenlere göre farklılık gösterebilmektedir.

Tablo 5. Johansen Eşbütünlüşme Sınaması Sonuçları

| Değişkenler | Hipotez | Test Değerleri | | Kritik Değerler %5 | |
|---------------|---------|----------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | | λ_{iz} | λ_{max} Öz | λ_{iz} | λ_{max} Öz |
| AFRK - REDK | r = 0 | 16,776** | 15,370** | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 1 | 1,406 | 1,406 | 3,841 | 3,841 |
| AMRK - REDK | r = 0 | 36,139* | 32,022* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 4,117 | 4,117 | 9,164 | 9,164 |
| AVOCD - REDK | r = 0 | 166,510* | 154,175* | 25,872 | 19,387 |
| | r ≤ 1 | 12,335 | 12,335 | 12,518 | 12,518 |
| BADETO - REDK | r = 0 | 36,718* | 36,619* | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 1 | 2,098 | 2,898 | 3,841 | 3,841 |
| BATAS - REDK | r = 0 | 26,753* | 22,210* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 4,542 | 4,542 | 9,164 | 9,164 |
| DASYA - REDK | r = 0 | 16,628** | 14,379** | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 1 | 2,249 | 2,249 | 3,841 | 3,841 |
| DAVRU - REDK | r = 0 | 65,907* | 61,354* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 4,553 | 4,553 | 9,164 | 9,164 |
| DOCD - REDK | r = 0 | 40,812* | 36,834* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 3,977 | 3,977 | 9,164 | 9,164 |
| GASYA - REDK | r = 0 | 30,344* | 25,394* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 4,949 | 4,949 | 9,164 | 9,164 |
| GDASYA - REDK | r = 0 | 21,960* | 19,699* | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 1 | 2,261 | 2,261 | 3,841 | 3,841 |

* ve ** sırasıyla %1 ve %5 seviyesinde anlamlılığı göstermektedir. Gecikme uzunluğu olarak Schwartz Bilgi Kriterinden yararlanılmıştır.

Tablo 5 sonuçları farklı ülkelere ait gelen turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasında eşbütünlüşmenin varlığını ortaya koymaktadır. Buna göre ilgili seriler arasında uzun dönemli bir

ilişkinin varlığından söz edilebilir. Elde edilen sonuçlar karşılıklı olarak en az bir eşbütünleşik vektörün olduğunu göstermektedir. Eşbütünleşme ilişkisinin varlığından hareketle reel efektif döviz kurundan Gelen Turist (GT) sayılarına yönelik tek yönlü incelenen hata düzeltme modeli sonuçları Tablo 6'da görülebilir. Hata düzeltme modeline ilişkin sonuçların içeriği değişkenlere ve kullanılan gecikmeye göre farklılaşabilmektedir.

Çünkü optimal eşbütünleşme ilişkisinin varlığı lineer deterministik trend ile sabitin var olduğu veya olmadığı farklı gecikmelere sahip modeller için rapor edilmiştir. Bununla birlikte, hata düzeltme modelinin işleyebilmesi için hata terimi ECT katsayısının -1 ile 0 arasında olması ve anlamlı olması gerekmektedir. Bu durum kısa dönemde oluşan dengeden sapmaların uzun dönemde ortadan kalktığını da göstermektedir. Tablo 6 bu açıdan incelendiğinde tüm modeller için hata düzeltme modelinin işlediğini sadece reel efektif döviz kuru endeksi ile Doğu Asya ülkelerinden gelen turist sayıları arasındaki hata düzeltme modelinin işlemediğini ortaya koymaktadır. Hata düzeltme modeli kısa ve uzun dönemli nedensellik ilişkilerinin birbirinden ayrılması avantajını sağlamaktadır. Bağımsız değişkenlerdeki gecikme değerleri, kısa dönemli nedensel etkileri, hata düzeltme terimi ise, uzun dönemli nedensel etkileri temsil etmektedir (Love ve Chandra, 2005; 136).

Tablo 6. Hata Düzeltme Modeli Sonuçları

| | C | ΔGT (t-1) | ΔRED K (t-1) | ΔGT (t-2) | ΔRED K (t-2) | ΔGT (t-3) | ΔRED K (t-3) | ECT | DW | F |
|---------------|-------------------|----------------------|----------------------------|----------------------|----------------------------|----------------------|----------------------------|--------------------|-------|-------------------|
| REDK → AFRK | 0,006 (0,460) | -0,324* (0,000) | 0,354 (0,636) | | | | | -0,08** (0,011) | 2,149 | 11,268 (0,000) |
| REDK → AMRK | | 0,028 (0,692) | 0,583 (0,613) | 0,269* (0,000) | -0,782 (0,500) | | | -0,208* (0,000) | 2,067 | 9,132 (0,000) |
| REDK → AVOEC | -0,002 (0,812) | 0,379* (0,000) | -0,578 (0,428) | -0,775 (0,291) | 0,633* (0,000) | | | -0,465* (0,000) | 2,55 | 56,947 (0,000) |
| REDK → BADETO | | 0,708* (0,000) | 0,922 (0,172) | -0,055 (0,498) | -1,794* (0,010) | 0,227* (0,001) | 1,052 (0,126) | -0,263* (0,000) | 1,876 | 32,580 (0,000) |
| REDK → BATAS | | 0,147** (0,044) | 0,180 (0,805) | | | | | -0,123* (0,000) | 2,034 | 8,222 (0,000) |
| REDK → DASYA | 0,007 (0,348) | -0,227* (0,002) | 0,220 (0,730) | | | | | -0,027 (0,244) | 1,879 | 4,223 (0,000) |
| REDK → DAVRU | | 0,335* (0,000) | -0,053 (0,899) | 0,382* (0,000) | -0,226 (0,597) | | | -0,334* (0,000) | 2,099 | 25,741 (0,000) |
| REDK → DOECD | | 0,516* (0,000) | 0,669 (0,314) | | | | | -0,213* (0,000) | 2,015 | 45,178 (0,000) |
| REDK → GASYA | | -0,166** (0,023) | 0,259 (0,804) | | | | | -0,239* (0,000) | 2,051 | 18,567 (0,000) |
| REDK → GDASYA | 0,008 (0,380) | -0,068 (0,356) | 1,242 (0,129) | | | | | -0,090* (0,003) | 2,017 | 4,475 (0,004) |

Parantez içerisindeki değerler olasılık değerleri olup * ve ** sırasıyla %1 ve %5 seviyesinde anlamlılığı göstermektedir. Gecikme uzunluğu olarak Schwartz Bilgi Kriteri'nden yararlanılmıştır.

Nedensellik ilişkisini değerlendirmek amacıyla ECT katsayıları incelendiğinde uzun dönemde reel efektif döviz kurunun Doğu Asya ülke grubu hariç tüm diğer ülke gruplarından gelen turist sayılarına neden olduğu söylenebilir. Uzun dönemde tespit edilen nedensellik ilişkisinin yönü normalleştirilmiş eşbütünleşme katsayılarından görülebilir.

Tablo 7. Kısa ve Uzun Dönem Nedensellik İlişkisi

| | Uzun Dönem | Kısa Dönem |
|--------------|-------------------|---------------------------|
| | REDK Katsayısı | Bütünleşik Wald (F) testi |
| REDK →AFRK | -5,670 [3,17] | 0,223 (0,636) |
| REDK →AMRK | -1,642 [1,122] | 0,289 (0,748) |
| REDK →AVOEC | -0,627 [4,459] | 1,153 (0,318) |
| REDK →BADETO | -1,562 [1,708] | 2,520 (0,059) |
| REDK →BATAS | -3,754 [2,486] | 0,060 (0,805) |
| REDK →DASYA | -7,853 [3,505] | 0,119 (0,730) |
| REDK →DAVRU | -0,961 [2,777] | 0,175 (0,839) |
| REDK →DOECD | -1,220 [1,300] | 1,019 (0,314) |
| REDK →GASYA | -2,515 [2,024] | 0,0613 (0,804) |
| REDK →GDASYA | -6,026 [3,173] | 2,322 (0,129) |

Köşeli parantez içerisindeki değerler t istatistikleridir. Parantez içerisindeki değerler olasılık değerleridir.

Kısa dönemdeki nedensellik ilişkisi ise modellerde yer alan $REDK_{t-1}$ ve varsa diğer gecikmeli $REDK_{t-n}$ katsayılarının Wald testi yardımıyla bütünleşik olarak sıfırdan farklı olup olmadığının sınanması neticesinde incelenebilir. Tablo 7’de tespit edilen uzun dönemli nedensellik ilişkisinin yönünü görmek üzere normalleştirilmiş eşbütünleşme katsayıları ile kısa dönem için hata düzeltme modeline bağlı bütünleşik Granger nedensellik analizi sonuçlarına yer verilmiştir.

Tablo 7 incelendiğine reel efektif döviz kuru endeksinin eşbütünleşme vektöründe yer alan normalleştirilmiş katsayı işaretçilerin negatif olduğu görülmektedir. Buna göre uzun dönemde reel efektif döviz kurundan gelen turist sayısına doğru olan nedensel ilişkinin negatif yönlü olduğu söylenebilir. Diğer bir ifadeyle uzun dönemde reel efektif döviz kurundaki azalışlar (TL’nin değer kaybetmesi) gelen turist sayılarını anlamlı olarak arttırmaktadır. Benzer şekilde reel efektif döviz kurundaki artışlar (TL’nin değer kazanması) gelen turist sayısını azaltmaktadır. Bu konuda anlamlı etkilerin olmadığı tek ülke grubu Doğu Asya ülke grubudur. Kısa dönemli nedenselliğin incelendiği bütünleşik Wald testi sonuçları ise hata düzeltme modeline bağlı Granger nedensellik analizi olarak ifade edilmekte ve “nedensellik yoktur” boş hipotezinin tüm ülke gruplarında reddedilemeyeceğini

ortaya koymaktadır. Diğer bir ifade ile kısa dönemde, reel efektif döviz kuru ile ülke gruplarından gelen turist sayıları arasında nedensellik söz konusu değildir. Bu bulguya aynı zamanda Tablo 6'da yer alan $REDK_{t-1}$ ve varsa diğer gecikmeli REDK katsayılarının anlamlılığı incelenerek ulaşılabilir.

6.SONUÇ

Bu çalışmada reel efektif döviz kurunun farklı ülke gruplarından gelen turist sayıları üzerinde kısa ve uzun dönemde etkisi olup olmadığını incelenmiştir. Bu bağlamda aylık frekanstaki verilerden yararlanılarak her ülke grubu için reel efektif döviz kuru ile gelen turist sayıları arasında ayrı ayrı eşbütünleşme ve hata düzeltme modeli uygulanmıştır. Aylık frekanstaki veriler üzerine gerçekleştirilen analizler Ocak 2003–Aralık 2017 dönemini kapsamaktadır. Analizlerden elde edilen sonuçlar uzun dönemde Doğu Asya ülke grubu hariç diğer tüm ülke gruplarından gelen turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasında negatif yönlü nedensellik ilişkisi olduğunu ortaya koymaktadır. Buna göre döviz kurundaki artışlar gelen turist sayılarını uzun dönemde azaltırken bu durumun tam tersi de geçerlidir. Kısa dönemli nedensellik ilişkisinin sonuçları ise döviz kuru ile gelen turist sayıları arasında anlamlı bir nedensellik ilişkisi olmadığını ortaya koymaktadır. Diğer bir ifade ile kısa dönemde döviz kuru değişimlerinin gelen turist sayıları üzerinde bir etkisi tespit edilememiştir. Bu çalışmada elde edilen bir sonuç olan uzun dönemli nedenselliğin kısa dönemde olmaması durumu Tang (2013) çalışmasında da tespit edilen bir sonuçtur. Ayrıca uzun dönemde tespit edilen gelen turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasındaki negatif yönlü nedensellik ilişkisi Bahar (2007), Kuo ve diğ. (2010), Agiomirgianakis ve diğ. (2014) çalışmalarında da tespit edilmiştir.

Çalışma sonuçlarından birisi olan Doğu Asya ülke grubundan Türkiye'ye gelen turist sayısı ile reel efektif döviz kuru arasında anlamlı bir nedensellik bulunamamasının çeşitli sebepleri olabilir. Benzer bulgulara ulaşan Kiang ve diğ. (2015) çalışmasında Turizm'in önceden planlanan ve satın alınan bir faaliyet olduğu ifade edilmektedir. Buna göre Doğu Asya ülke grubundan Türkiye'ye gelen turist sayısı arasında nedensellik olmaması bu argüman ile açıklanabilir.

Çalışmadan elde edilen sonuçlar politika yapıcılar açısından değerlendirildiğinde döviz kurundaki olumsuz hareketlerin uzun dönemde gelen turist sayılarını etkileyeceğini dolayısıyla döviz kurundaki hareketliliğin düşük olduğu dönemlerde uzun dönemli planlamalar yapılarak gelen turist sayılarının korunabileceğini söylemek mümkündür. Turizm acentelerinin bu konuda yapabilecekleri ve bunun etkileri ise yeni çalışmaların konusunu oluşturacaktır.

KAYNAKÇA

Agiomirgianakis, G., Serenis, D., & Tsounis, N. (2014). Exchange Rate Volatility and Tourist Flows into Turkey. *Journal of Economic Integration*, 700-725.

***ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES***

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Agiomirgianakis, G., Serenis, D., & Tsounis, N. (2015). The Effects of Exchange Rate Volatility on Tourist Flows: Evidence from the UK and Sweden. *International Journal of Tourism Policy*, 6(1): 1-16.

Bahar, O. (2007). Türkiye'deki Devalüasyon Uygulamalarının Turizm Sektörü Üzerindeki Etkisi. *Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 12(1): 255-272.

Belloumi, M. (2010). The Relationship between Tourism Receipts, Real Effective Exchange Rate and Economic Growth in Tunisia. *International Journal of Tourism Research*, 12(5): 550-560.

Bozkurt, K., & Pekmezci, A. (2015). Turizm Talebi ve Döviz Kuru Şokları: Türk Turizm Sektörü İçin Ekonometrik Bir Analiz. *Eskişehir Osmangazi Üniversitesi İİBF Dergisi*, 10(2): 91-105.

Chiu, Y.B., Yeh, L.T., (2017). The Threshold Effects of the Tourism-Led Growth Hypothesis: Evidence from a Cross-Sectional Model. *Journal of Travel Research*, 56(5): 625-637.

Crouch, G.I., (1993). Currency Exchange Rate and the Demand for International Tourism. *Journal of Tourism Studies*, 4(2): 45-53.

Crouch, G. I. (1994). The Study of International Tourism Demand: A Review of Findings. *Journal of Travel Research*, 33(1): 12-23.

Demirel, B., Bozdağ, E. G., & İnci, A. G. (2008). Döviz Kurlarındaki Dalgaların Gelen Turist Sayısına Etkisi: Türkiye Örneği. DEÜ Ulusal İktisat Kongresi, İzmir, http://www.deu.edu.tr/userweb/iibf_kongre/dosyalar/demirel.pdf (Erişim Tarihi: 30 Ağustos 2018).

Dickey, D. A., & Fuller, W. A. (1979). Distribution of the Estimators for Autoregressive Time-Series with a Unit Root. *Journal of the American Statistical Association*, 74(366a): 427-431.

Dickey, D. A., & Fuller, W. A. (1981). Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time-Series with a Unit Root. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, 1057-1072.

Enders, W. (2008). *Applied econometric time series*. John Wiley & Sons.

Engle, R. F., & Granger, C. W. (1987). Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, 251-276.

Farver, J. A. M. (1984). Tourism and Employment in the Gambia. *Annals of Tourism Research*, 11(2): 249-265.

Fuller, W. A. (2009). *Introduction to Statistical Time Series (Vol. 428)*. John Wiley & Sons.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Göymen, K. (2000). Tourism and Governance in Turkey. *Annals of Tourism Research*, 27(4): 1025-1048.

Henderson, J. O. A. N. (2001). Tourism and the Arts: A View from Singapore. *Tourism Culture and Communication*, 3(1): 27-36.

Johansen, S. (1988). Statistical Analysis of Cointegration Vectors. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 12(2-3): 231-254.

Johansen, S., & Juselius, K. (1990). Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration—with Applications to the Demand for Money. *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 52(2): 169-210.

Kiang, Y. J., Sarochanajeen, O., Yang, F. J., & Wang, Y. H. (2015). Relationship between Exchange Rates and Tourist Number in Thailand: Empirical Analysis of Panel Data. *Journal of Accounting, Finance & Management Strategy*, 10(2): 107.

Kuo, H. I., Wang, H. C., Hwang, W. Y., & Ye, C. Y. (2009). Tourism demand and exchange rates in Asian countries: Evidence from a panel data approach. In *Computer Science and Information Engineering, 2009 WRI World Congress on 4*: 508-512. IEEE.

Kutlar, A. (2000). *Ekonometrik Zaman Serileri*. Gazi Kitabevi.

Leiper N., (2008). Why 'the Tourism Industry' is Misleading as a Generic Expression: The Case for the Plural Variation, 'Tourism Industries'. *Tourism Management*, 29(2): 237-251.

Nelson, C. R., & Plosser, C. R. (1982). Trends and Random Walks in Macroeconomic Time-Series: Some Evidence and Implications. *Journal of Monetary Economics*, 10(2): 139-162.

Paramati, S.R., Alam, M.S. and Chen, C.F., (2017). The Effects of Tourism on Economic Growth and CO2 Emissions: A Comparison between Developed and Developing Economies. *Journal of Travel Research*, 56(6): 712-724.

Phillips, P. C. B. (1988). Testing for a Unit Root in Time-Series Regression. *Biomètrika*, 75(2): 335-46.

Quadri, D. and Zheng, T., (2010). A Revisit to the Impact of Exchange Rates on Tourism Demand: The Case of Italy. *Journal of Hospitality Financial Management*, 18(2): 47-60.

Samırkaş, M., & Samırkaş, M. C. (2015). The Impact of Exchange Rate on Tourism Industry: The Case of Turkey. In *Handbook of Research on Global Hospitality and Tourism Management* 107-118. IGI Global.

***ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES***

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Sinclair, M. T. (1998). Tourism and Economic Development: A Survey. *The Journal of Development Studies*, 34(5): 1-51.

Stettler, C. (2017). How Do Overnight Stays React to Exchange Rate Changes?. *Swiss Journal of Economics and Statistics*, 153(2): 123-165.

Tang, C. F. (2013). Temporal Granger Causality and the Dynamics Relationship between Real Tourism Receipts, Real Income and Real Exchange Rates in Malaysia. *International Journal of Tourism Research*, 15(3): 272-284.

Tarı, R. (2010). *Ekonometri* (6. Baskı). Kocaeli: Umuttepe Yayınları.

Vanegas Sr, M., and Croes, R. R. (2000). Evaluation of Demand: US Tourists to Aruba. *Annals of Tourism Research*, 27(4): 946-963.

De Vita, G. and Kyaw, K.S., (2013). Role of the Exchange Rate in Tourism Demand. *Annals of Tourism Research*, 43: 624-627.

Wang, L., & Tang, X. (2018). Does RMB Exchange Rate Volatility Affect Beijing's Inbound Tourism Development?. In 2018 4th International Conference on Information Management (ICIM)(206-209). IEEE.

Webber, A. G. (2001). Exchange Rate Volatility and Cointegration in Tourism Demand. *Journal of Travel Research*, 39(4): 398-405.

**THE ANALYSIS FOR THE VALIDITY OF EFFICIENCY AND
COMPENSATION HYPOTHESIS IN EURO AREA: EVIDENCE FROM PANEL
DATA ANALYSIS**

Fatih MANGIR*

Fatih AYHAN**

ABSTRACT

As an inherent feature of capitalism, globalization creates some potential benefits and risks for the interconnected economies. Economists have known for long time that globalization (trade or capital openness) causes some external risks that national states forced to protect their citizenship from these risks and provide some social spending for their benefits. On the other hand, the impact of economic globalization on the welfare state remains a debatable issue over the recent years. While some states that increase in trade openness leads to large state spending, the other claims that there is a negative association between trade openness and government size due to the social protection accommodated by increasing tax revenues.

In this article, we tried to test the validity of the compensation and efficiency hypotheses for the Eurozone over the period 1995-2015. The effect of trade openness on government expenditure is found negative and statistically significant at %1 significance level according to econometric model. Our result supports the hypothesis of efficiency for Euro Area.

Key Words: *Trade openness, Government Size, Compensation and Efficiency hypothesis, Globalization*

* Assoc. Prof. Dr., Department of Economics, Selcuk University, Konya, Turkey, E-Mail: fmangir@selcuk.edu.tr.

** Asst. Prof., Bandırma Onyedi Eylül University, Gonen Vocational School, Balıkesir, Turkey, E-Mail: fayhan@bandirma.edu.tr

1.INTRODUCTION

Evidence for the claim that there is a positive relationship between trade openness and public expenditure is referred to as the “compensation” hypothesis. According to this hypothesis, the size of the public sector is relatively high in countries adopting more open trade policies. This hypothesis also states that public spending in a country is positively correlated with trade openness. The main idea of this hypothesis driven from the assumption is that in a process of openness of the national economy, the government should provide social protections for its citizens against external risks. Increase in trade openness, economies may lead to external shocks such as export concentration and terms of trade volatility. In addition, all governments have forced to provide social protections (social security, pensions, unemployment insurance, job training) during the economic crisis related to globalization periods.

Besides, opposite view describes negative relations between trade openness and public size. This view called the “efficiency” hypothesis explores that trade openness creates pressures an increase of government tax rate as state needs lessen tax rate to attract more foreign capital flows during the globalization process.

Although there is no consensus (both at a theoretical and empirical level) on empirical studies about the nexus between the globalization and government expenditures, determining the direction of this relation is worthwhile to understand the way in which the government deals with globalization process . Since the results of all analysis will serve good policy recommendations to economists about the futures of fiscal policies. Most of the studies on this relation based on the article of Rodrik (1998) trying to explain the impact of trade openness on government spending. Rodrik warned governments against the globalization threats by underlying the dominant power of economic nationalism over the free market. He states that globalization clearly serve some benefits for the sectors that countries have specialized in. However, comparatively disadvantages sectors have experienced some losses due to the global integration process. Therefore, these sectors or citizens demand a higher social protection by increasing public expenditure from the government.

The euro area, created in 1999, is a monetary group consisting of 19 countries¹³ of the European Union with the euro as the common currency. Government Spending in the Euro Area averaged 464.52 EUR Billion from 1995 until 2016, reaching an all time high of 531.23 EUR Billion in the fourth quarter of 2016 and a record low of 383.06 EUR Billion in the first quarter of 1995¹⁴. In addition, there has been

¹³ Austria, Belgium, Cyprus, Estonia, Finland, France, Germany, Greece, Ireland, Italy, Latvia, Lithuania, Luxembourg, Malta, the Netherlands, Portugal, Slovakia, Slovenia and Spain.

¹⁴ <http://www.tradingeconomics.com/euro-area/government-spending>

a significant increase in trade opening in the area. According to data from the World Bank, the opening rate in the euro area, which stood at 98% of GDP in 1995, was 140% in 2015. This demonstrates the high degree of openness in eurozone.

The aim of this article is to examine an econometric relationship between the trade openness as an proxy of globalization and public expenditure in the 19 euro area countries in the period 1995-2015. We test whether any relationship between government expenditure and trade openness exists by using CCEMG (Dynamic Common Correlation Effects Mean Grup Estimator) Dynamic estimator model.

The remainder of this study is organized as follows. Section II reviews related literature on the compensation and efficiency hypothesis. Later, we present the data, methodology and empirical results used in Section III. Finally, the conclusion of the study is summarized in Section IV.

2. REVIEW OF THE LITERATURE

Many authors have tested the relationship between public expenditure and trade openness. For some authors, there is enough evidence to support the compensation hypothesis that there is a positive relationship between two variables. The others, however found a weak support for the compensation hypothesis.

The first analysis performed by Cameron in 1978. He analyzed the nexus between public expenditure and trade openness for a sample of 18 OECD countries for the years 1960-1975 averages, using the OLS cross section estimator. The underlying assumption is that increasing trade openness can facilitate the development of social infrastructure - the density of unionization, the scope of collective bargaining and the strength of labor confederations - and lead to a broadening of the public expenditure. He found a positive relationship between government revenue and trade openness. Rodrik (1998) also support the compensate hypothesis using government consumption and trade openness, for 125 developed and developing countries, for the years 1985-1989 and 1990-1992 average, using the OLS cross section estimator.

Shahbaz M, Rehman HU, Amir N. (2010) studied the effects of trade and financial openness on public spending in Pakistan. Using the co-integration technique and the error correction method for short-term analysis, the results showed that trade openness was positively related to public spending in Pakistan during the study period.

Parviz Khanlou KF (2014) argued that trade openness is positively correlated with public expenditure in ECO countries, while financial openness has a negative effect on economic growth.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Recent contributions have challenged the existence of a positive relationship between trade openness and public spending. They suggest that either the size of governments has not changed to mitigate the effects of greater openness (Islam 2004) or that causality from trade openness to government size is not supported by data (Molana and al. 2004). Garen and Trask (2005) also argue that considering non budgetary measures of government size (like government ownership, price controls, barriers to trade, etc.) less open countries tend to have larger public sectors.

Garrett and Mitchell (2001) found a negative coefficient for trade openness, a negative coefficient for low wage imports and an insignificant coefficient for foreign direct and international financial openness on government spending, government consumption and social security transfers, for 18 OECD countries, for the years 1961-1993, using the linear regression with panel-corrected standard errors estimator.

Alesina and Wacziarg (1998) used cross-sectional data including Latin America, sub-Saharan Africa, South-East Asia and OECD countries to examine the link between trade openness, country size and government spending covering the period 1960-1989. Overall, the results show that the size of the country is negatively related to public spending and that it is also negatively related to trade openness. Aydogus I, Topcu M (2013) studied the relationship between openness and public spending in Turkey between 1974 and 2001. Using a residual co-integration approach, they were not found a long-term relationship between public spending and trade openness.

Fatma Z. and Suzan E. (2013) verified the compensation hypothesis in the euro union. Their study covers 15 countries over the period from 1971 to 2011. The analysis results confer the assumption of compensation in the euro union. This study has the same meaning. As far as we are concerned, our study covers a large sample of countries (19 in total). In addition, the European Union was created in 1999. However, the study period of Fatma Z and Suzan E predates the creation of the European Union, this may bias the results. In addition, our study concerns only countries with a common currency (Euro).

3. DATA, METHODOLOGY AND EMPIRICAL RESULTS

3.1. Data and Methodology

In this study, we looked for the causal relationship between openness and public spending for 19-euro area countries over the period 1995-2015. These countries are Germany, Austria, Belgium, Estonia, Finland, France, Netherlands, Ireland, Spain, Italy, Cyprus, Latvia, Lithuania, Luxembourg, Malta, Portugal, Slovakia Slovenia, Spain and Greece.

We used the ratio of public consumption expenditures to gross domestic product (GDP) as the public size indicator (general government final consumption expenditure as a percentage of GDP) and

used the sum of exports and imports for commercial open (open) in the gross domestic product (Exports plus imports as a share of GDP). The data are taken from the World Bank's World Development Indicators (WDI) database. The analysis of econometric models was done with Stata 14 and Gauss 10 software programs.

Table 1. Short Descriptive of Variables

| Variables | Decsrption |
|-----------|---|
| GOV | General government final consumption expenditure as a percentage of GDP |
| OPEN | Exports plus imports as a percentage of GDP |

Table 2. Descriptive Statistics

| | Mean | Minimum | Maximum | Std.d Dev | Obs. |
|------|---------------|---------|---------------|--------------|------|
| GOV | 19.47 | 12.02 | 26.48 | 2.51 | 399 |
| OPEN | 117.90 | 37.10 | 391.49 | 68.51 | 399 |

In order to analyze the compensation and efficiency hypothesis, the methodology represented in equation (1) is employed:

$$LG_{it} = \lambda_{it}d_t + \alpha_{1i}LT_{it} + u_{it} \quad (1)$$

$$u_{it} = \theta_i f_t + \varepsilon_{it}, \quad i=1,2,\dots,N \text{ and } t=1,2,\dots,T$$

Where LG and LT indicates the ratio of public expenditure over GDP and trade openness respectively; d_t is observed common effects, f_t is unobserved common effects and ε_{it} denotes the error term.

Firstly, the cross-sectional dependency and the homogeneity tests have been performed to determine the appropriate methodology of panel data analysis in our study.

Cross sectional dependence is a problem for panel data econometrics. Ignoring the problem of the cross-sectional dependence may lead to two following biases in panel analysis:

- Cross-sectional dependence error may lead to false results estimated by the conventional unit root tests due to important size distortions (O'Connell, 1998).
- Without cross-sectional dependence test, we have also inconsistent fixed or random effects results (Sarafidis & Robertson, 2009).

In the empirical modeling, we firstly analyze the cross sectional dependence problem of data. As in our data set, cross sectional dimension is smaller than the time dimension in the panel ($N < T$), We preferred to use the Bias Adjusted LM test developed by Pesaran et al. (2008) in order to solve the dependency problem.

The bias-adjusted CD test is presented in equation (2):

$$LM^* = \sqrt{\frac{2T}{N(N-1)}} \left(\sum_{i=1}^{N-1} \sum_{j=i+1}^N \hat{\rho}_{ij} \right) \frac{(T-k)\hat{\rho}_{ij}^2 - E(T-k)\hat{\rho}_{ij}^2}{\text{var}(T-k)\hat{\rho}_{ij}^2} \quad (2)$$

where $\hat{\rho}_{ij}$ is the sample estimate of the pairwise correlation of the residuals obtained by OLS (Hernández Salmerón & Romero-Ávila, 2015).

For the presence of such cross-sectional dependence in our data and model, we employed the cross-section augmented Dickey Fuller (CADF) method known as second generation tests.

The CADF regression can be written as follows (Paseran, 2007):

$$\Delta x_{it} = z_{it}'\gamma + \rho_i x_{it-1} + \sum_{j=1}^{p_i} \varphi_{ij} \Delta x_{it-j} + \alpha_i \bar{x}_{t-1} + \sum_{j=0}^{p_i} \eta_{ij} \Delta \bar{x}_{t-j} + v \quad (10)$$

where \bar{x}_t is the cross-section mean of x_{it} , $\bar{x}_t = N^{-1} \sum_{i=1}^N x_{it}$, v is the random error.

The average of the N individual CADF statistics referred as as the cross-sectionally augmented IPS (CIPS) and is formulated as follows:

$$CIPS = \bar{t} = N^{-1} \sum_{i=1}^{N_i} t_i, \quad (11)$$

where t_i is the ordinary least squares t -ratio of ρ_i in Equation (10). The critical values of the test statistics are given in Pesaran (2007).

After we found that all the variables are I(1), we investigate the co-integration relationship between the variables by employing the Durbin-Hausman co-integration test developed by Westerlund (2008). The Durbin-Hausman test includes two tests first is panel (DHp) test and the second is group (DHg) test which takes cross-sectional dependence into consideration. The null hypothesis for both tests indicates no co-integration relationship between variables. The difference between two tests is the DHp test assumes the autoregressive parameter is the same for all cross-sections whereas the DHg permits the

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES**

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

autoregressive parameter to differ across cross-sections. If we reject the null hypothesis, we conclude that there is long term co-relationship between the variables.

Then, we investigate slope heterogeneity properties of the model. If we assume slope homogeneity and employ pooling of individual groups, we also assume only the intercepts to differ across the groups and could employ fixed effects, random effects and instrumental variable estimators. However, if slope homogeneity assumption is not valid, we could have biased results by employing traditional estimators. In most panels with large N and T, the slope is heterogeneous (Pesaran and Smith, 1995; Im et al., 2003).

In order to analyze slope heterogeneity, we used Pesaran and Yamagata's (2008) test which also takes cross section dependence into account. The test employs a rescaled version of the Swamy Test (Swamy, 1970) and has superior properties according to both size and power over a variety of specifications of N and T (Juhl and Lugovskyy, 2014).

We finally employ the dynamic common correlated effects mean group estimator (Dynamic CCEGM) model proposed by Pesaran and Chudik (2015) because we have both cross sectional dependency and slope heterogeneity problems. Dynamic CCEGM model is robust to both slope heterogeneity and cross sectional dependence.

CCEMG estimator was first proposed by Pesaran (2006) and developed by Kapetanios et al. (2011). The difference between CCEMG estimator and the dynamic CCEMG estimator includes the lagged values of dependent variable and lags of cross sectional means as explanatory variables in the model. The CCEMG estimator is also present superior results for structural breaks besides cross-sectional dependence and slope heterogeneity. The CCEMG model used in this paper is presented in equation 5.

$$y_{it} = \alpha_{0i}y_{it-1} + \alpha_{1i} + \beta_i x_{it} + \sum_{j=1}^n \delta_i \bar{y}_{it-j} + \sum_{j=1}^n \theta_i \bar{x}_{it-j} + \varphi_i f_t + \varepsilon_{it} \quad (5)$$

where y_{it} is the dependent variable, α_{1i} is the group of fixed effects taking into consideration time-invariant heterogeneity across groups, x_{it} is the vector of regressors, \bar{x}_{it-i} and \bar{y}_{it-1} are the lags of cross-sectional averages, β_i represents the country-specific slope on the observable regressor, f_t is the unobserved common factor with heterogeneous factor loadings ϕ_i , and ε_{it} denotes the error term.

3.2. Empirical Results

We firstly checked cross sectional dependence by employing the Bias Adjusted LM tests. Table 3 presents the results of the Bias Adjusted LM tests. Null hypothesis implies no cross sectional dependence.

Table 3. Cross-Dependency Test Results

| | | |
|-----------------|--------|-------|
| CD tests | Stat | Prob |
| LMadj | 69.260 | 0.000 |

* indicates %1 significance level. Null hypothesis shows no cross sectional dependence

According to Table 3, null hypothesis is rejected. This shows that there is cross sectional dependence and we should use the methods, which consider cross-sectional dependence.

After cross sectional dependence check, in order to investigate stationarity of the variables we employ CIPS test proposed by Peseran (2007) which take into account cross sectional dependence. CIPS test results are presented in Table 4.

Table 4. CIPS Unit Root Test Results

| | Level | | First Difference | |
|-------------|----------|------------------|------------------|------------------|
| | Constant | Constant + Trend | Constant | Constant + Trend |
| GOV | -1.424 | -1.914 | -3.722* | -3.786* |
| OPEN | -1.312 | -1.342 | -2.788* | -2.935* |

* indicates a 1% significance level

The test results for the variables in levels and in first differences are presented in Table 4. The CIPS test statistics are unable to reject the hypothesis that all countries have a unit root in levels. Since the unit root hypothesis can be clearly rejected for the first differences, it can be concluded that *GOV* and *OPEN* are integrated of order one, I(1).

After stationarity check, we investigated the co-integration relationship between the variables by employing the LM Bootstrap Panel Cointegration Test developed by Westerlund and Edgerton (2007).

Table 5. LM Bootstrap Cointegration Test Results

| | | |
|--|---------------------------|----------------------|
| Dependent variable: General government final consumption expenditure as a percentage of GDP (GOV) | LM test Statistics | The p-value |
| Independent variables: Exports plus imports as a percentage of GDP (OPEN) | 7.393 ^a | (0.000) ^b |

a Notes: Null hypothesis (H0) is cointegration in the panel against alternative hypothesis (H1) of no cointegration. a LM is Lagrange multiplier. See Westerlund and Edgerton (2007) for details of the test procedure. b The p-value denotes the bootstrap p-value.

According to Table 5, the bootstrap p-value is lower than the critical values, and the null hypothesis of co-integration is rejected. As a result, we found no significant long-run co-integration relationship between government expenditure and trade openness by employing LM Bootstrap Cointegration Test Results.

In order to test for slope heterogeneity, we used the slope heterogeneity test proposed by Pesaran and Yamagata (2008). The slope heterogeneity test results presented in Table 5.

Table 6. Slope Heterogeneity Test Results

| | | |
|------------------|--------|-------------|
| Delta_tilde: | 14.142 | prob= 0.000 |
| Delta_tilde_adj: | 15.218 | prob= 0.000 |

As can be seen from the Table 6, all statistics indicates the rejection of the null hypothesis of slope homogeneity. We conclude that the slope is heterogeneous and employ the estimator that take the slope heterogeneity into account. We employ Dynamic CCEMG model proposed by Pesaran and Chudik (2015) which is robust to both slope heterogeneity and cross sectional dependence. We present the results of dynamic CCEMG model in Table 6.

Table 7. Dynamic CCEMG Estimator Results

| Dependent Variable: GOV | Katsayılar |
|--------------------------------|-------------------|
| GOV (-1) | 0.569* |
| OPEN | -0.089 ** |
| Constant | -8.901*** |

*, ** and *** denotes respectively %1, %5 and %10 significance level

According to Table 6, trade openness variable has positive and statistically significant negative effect on government expenditure. This results show that efficiency hypothesis is valid for Eurozone countries as a panel. For this reason, it seems that policy makers in these countries decreased their government expenditure against the increasing pressure for globalization. Focused on the effect of trade openness on the government expenditures, this study finds consistent results with the efficiency hypothesis, means that globalization leads to a reduction in the size of public sector through budget and welfare spending. Our results may be associated fiscal austerity in the Eurozone that policy makers decided to tackle the Eurozone crisis by imposing fiscal austerity to deficit countries.

4. CONCLUSION

This paper has econometrically investigated the effect of the globalization (trade openness as proxy) on government spending in the Eurozone over the period 1995-2015. The findings of the econometric analysis show that the economic openness have a significant negative effect on government expenditure - supporting the efficiency hypothesis. This hypothesis says basically that trade openness creates pressure an increase of government tax rate and a decrease government size as state needs lessen tax rate to attract more foreign capital flows during the globalization process.

The validity of efficiency hypothesis indicates that the increasing trade liberalization in the Euro area countries may be considered healthy as far as government growth size is constrained. As many studies have shown that decrease in government, spending in many developing countries could help to make them competitive in the long term especially if the revenue promotes productivity. Government expenditures in the economy to control and protect the cost of globalization could block long run growth especially if the saving is channeled into investment and research intensive sectors.

REFERENCES

- Alesina A. and Wacziarg, R. (1998) "Openness, Country Size And Government". *Journal of Public Economics*, 69 (3): 305-321.
- Aydoğuş, İ. and Topçu, M. (2013) "An Investigation of Co-Integration and Causality between Trade Openness and Government Size in Turkey", *International Journal of Economics and Financial Issues*, 3(2): 319-323.
- Cameron, D.R. (1978) "The Expansion of the Public Economy: A Comparative Analysis", *American Political Science Review*, 72: 237-269.
- Fatma Z. and Suzan E. (2013) "Ticari Açıklık Ve Kamu Büyüklüğü İlişkisi: Panel Nedensellik Testi", *Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi*, 27 (4).
- Garen J. and Trask K.. (2005) "Do more open economies have bigger governments? Another look", *Journal of Development Economics*, 77 (2): 533-551.
- Garrett G. and Mitchell, D. (2001). "Globalization, Government Spending And Taxation In The OECD". *European Journal Of Political Research*, 39 (2): 145-177.
- Islam MQ. (2004) "The Long Run Relationship Between Openness And Government Size: Evidence From Bounds Test", *Applied Economics*; 36:995-1000.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Molana H, Montagna C, Violato M. (2004) "On The Causal Relationship Between Tradeopenness And Government Size: Evidence from 23 OECD countries", University of Dundee Discussion Paper. 164.

Molana, H., Montagna, C., Violato, M. (2004), "On the Causal Relationship between Trade-Openness and Government Size: Evidence from 23 OECD Countries", University of Dundee Discussion Paper No. 164.

Parvizkhanlou KF. (2014), "An Impact Of Trade And Financial Openness On Government Size: A Case Study For ECO". IRC'S International Journal of Multidisciplinary Research in Social & Management Sciences. 2(2):1-4.

Rodrik, D. (1998), "Why Do More Open Economies Have Bigger Governments?" Journal of Political Economy, 106, 997–1032.

Ruggie, John G. (1982), "International Regimes, Transactions, and Change: Embedded Liberalism in the Postwar Economic Order", International Organization 36 (2):195–231.

Shahbaz, M., Rehman, H. U., and Amir N. (2010). "The Impact of Trade and Financial Openness on Government Size: A Case Study of Pakistan" , Journal of Quality and Technology Management , VI (1): 105 – 11.



ALT İŞVEREN ÇALIŞANLARI PERSPEKTİFİNDEN, YÖNETİCİLERİN İŞ GÜVENLİĞİNE BAĞLILIĞI DÜZEYLERİNİN İNCELENMESİ: BELEDİYE ÇALIŞANLARI ÖRNEĞİ

Bülent ARPAT*

ÖZET

Asıl işveren işçileri ile alt işveren işçilerinin asıl işverenin işyerinde birlikte çalışması nedeniyle, tekli bir örgütsel yapıda, iki farklı çalışma grubu mevcuttur. İşletme yönetimlerinin güvenliğe yönelik bağlılıklarının çalışanlarca pozitif biçimde algılanması için, her iki grupta da yönetimlerinin güvenlik bağlılığı (YGB) algısının yüksek ve birbirine yakın düzeylerde olması arzu edilmektedir. Böyle bir resim, iş sağlığı ve güvenliğine (İSG) ve güvenlik kültürüne/iklimine katkı sağlaması bakımından önemlidir. Araştırmanın amacı, bir belediye özelinde çalışan asıl ve alt işveren işçilerinin, yöneticilerine ait iş güvenliği bağlılığı düzeyi algılarını tespit etmektir. Bu yolla yapılacak karşılaştırma ile, gerek güvenlik ikliminin/kültürünün gerekse iş güvenliği mevzuatının önemli bir bileşeni olan çalışanların güvenlik katılımıyla ilgili değerlendirmelerde bulunulması hedeflenmektedir. Araştırma nicel araştırma deseninde, kesitsel ve deneysel olmayan teknikte yürütülmüştür. Araştırma bulgularına göre her iki grup, yöneticilerinin İSG bağlılıklarını “yüksek” düzeyde algılamaktadır. Ancak gruplar arası farklılık taşeron çalışanlar lehine istatistiksel olarak anlamlı derecede daha yüksektir. Bu bulguya göre taşerona bağlı çalışanların, iş güvencesinden kaynaklanan endişelerle yönetici bağlılıklarını daha yüksek düzeylerde algıladıkları anlaşılmaktadır. Bu durum, çalışanın İSG faaliyetlerine katılımının gönül gücüyle bilinçli bir katılım yerine, salt işverenin talebinden kaynaklanan zorunlu bir katılım olarak görülmektedir.

Anahtar Kelimeler: İş Sağlığı ve Güvenliği, Yönetimin İş Güvenliği Bağlılığı, Alt İşveren, Taşeron.

JEL Kodları: J28, J53, J71

INVESTIGATION OF THE LEVELS OF ADMINISTRATORS' COMMITMENT TO OCCUPATIONAL SAFETY FROM THE PERSPECTIVE OF SUBCONTRACTOR EMPLOYEES: THE SAMPLE OF MUNICIPALITY EMPLOYEES

ABSTRACT

There are two different working groups in a single organizational structure, as the main employer workers and subcontractor workers work together in the workplace. In order for employees to perceive

* Pamukkale Üniversitesi, barpat@pau.edu.tr, Denizli, Türkiye.

their commitment to safety in a positive way by employees, it is desirable that both groups have high levels of safety commitment of managers perceptions. Such a picture is important for contributing to occupational health and safety (OHS) and safety culture / climate. The aim of the study is to determine the perceptions of the level of job safety commitment of the principal and subcontractor employees working in a municipality. With this comparison, it is aimed to make evaluations about the safety involvement of the employees, which is an important component of the safety climate / culture and occupational safety legislation. The research was carried out in the quantitative research design, cross-sectional and non-experimental technique. According to the research findings, both groups perceive the OHS commitment of their managers as high level. However, the difference between the groups is statistically significantly higher in favor of subcontractors. According to this finding, it is understood that employees who are subcontractors perceive their executive commitment to higher levels with the concerns arising from work safety. This situation is considered as a compulsory participation due to the demand of the employer, rather than a conscious participation with the power of the employee in terms of participation of the employee in OHS activities.

Keywords: Occupational Health and Safety, Management Commitment on Safety, Subcontractor, Subcontracted Labour.

JEL Codes: J28, J53, J71

1.GİRİŞ

Yeni kamu yönetimi anlayışı ve buna bağlı olarak şekillenen kamu işletmeciliği yaklaşımı, vatandaş odaklılığı esas almaktadır. Bu yaklaşımın devamında ise kamu kaynaklarının etkin, verimli ve ekonomik kullanılması üzerinde durulmaktadır. Bu çerçevede özel sektör tarafından geliştirilen yöntemlerden daha fazla yararlanılması ve kamu kuruluşlarının işletme yönetimi mantığına göre yönetilmesi gerektiği ileri sürülmektedir (Yasım, 2018:289). Bu yaklaşım ile özellikle kamu çalışanları içinde, “alt işveren çalışanları” olarak bilinen ve daha düşük ücretli, oldukça düşük düzeylerde örgütlenen ve güvencesiz çalışan bir grup oluşmuştur. Çalışan grupları arasında çalışma ilişkisi değişkenleri açısından adil olmayan bu durum, alt işveren işçilerinin aynı zamanda iş sağlığı ve güvenliği açısından da dezavantajlı konuma getirmiştir.

Alt işverenliğin usul ve esasları, 2003 yılında çıkartılan 4857 sayılı iş kanununa dayanmaktadır. Yasada alt işveren ile iş aldığı diğer (asıl) işveren ilişkisi kapsamlı bir biçimde düzenlenmiştir. Düzenlemede çeşitli koşullar-kısıtlar getirilmiş, muvazaalı ilişkiler yaptırıma bağlanmıştır (Bakır, 2016:1002).

Kaya (2015) ve Ören (2016)'in araştırmalarına göre kamuda çalışan alt işveren işçilerinin en önemli sorunu ve beklentisi kadroya geçiş olarak tespit edilmiştir. Bu beklenti, 24.12.2017 tarihli resmi gazetede yayınlana 696 sayılı KHK ile büyük ölçüde çözüme kavuşturulmuştur. 02.04.2018 tarihinde tamamlanan süreç ile 04.12.2017 tarihi itibarıyla personel çalıştırılmasına dayalı hizmet alım sözleşmeleri kapsamında kamu kurumunda çalışan işçilere, sürekli işçi kadrolarına geçiş hakkı tanınmıştır.

2.ALT İŞVEREN İŞÇİLERİNDE İŞ SAĞLIĞI VE GÜVENLİĞİ

Taşeron çalışma İş sağlığı ve güvenliği (İSG) üzerinde de negatif etkileri oluşturmaktadır (Yasım, 2018:291). Bunun nedenleri arasında artmış iş yoğunluğu, İSG'de verilen tavizler, düşük eğitim, düşük denetim, çok sayıda işverenin olduğu iş yerlerinde çalışanlar arası yetersiz iletişim, yetersiz personel, kolektif sorunları dile getirmede azalmış kapasite, çalışanlar için daha az düzenleyici koruma gibi faktörler tespit edilmiştir (İzgi & Türkmen, 2012:163). Başka bir araştırmada kadınların çoğu iş sağlığı ve güvenliği eğitimi aldıklarını belirtip gerekli kişisel koruyucu ekipmanların kendilerine verildiğini ifade etmişlerdir. Ancak kadınlar ekipmanlara ulaşsa bile bunların yeterli kalitede olmadığını tek kullanımda kullanılamaz hale geldiğini belirtmişlerdi (Ulukan ve Yılmaz, 2016:104). Min vd. (2013:1302) yapmış oldukları çalışmada alt işveren işçilerinin asıl işçilerden önemli ölçüde fazla sağlık problemleri yaşadığını tespit etmiştir. İzgi ve Türkmen'in araştırmalarında ise (2012), taşeron çalışmanın sağlığı olumsuz etkilediği (%71,1), taşeron firmalardaki sağlık çalışanlarının enfeksiyon hastalıklarına yakalanma risklerinin daha fazla olduğu dile getirilmekte; bunun nedenleri arasında düşük eğitim düzeyi, riskli işlerin yapılması, yoğun çalışma temposu, sağlık hizmet işleyişine ilişkin genel bilgilerinin eksikliği, düzensiz işe giriş muayenesi, uyum eğitimi verilmeyişi sayılmaktadır.

Yönetimin İş Güvenliği Bağlılığı: Çalışanların tutum ve davranışları, üst ve orta yönetim kararlarından da etkilenmektedir. Bu kararlar ise örgütün güvenlikle ilgili önceliklerine ve politikalarına uygun olarak ortaya çıkarlar (Özkan ve Arpat, 2018:265-266). Bu kararlar ve gereği olan eylemlerin güvenlik politikası ve önceliklerine uygun olması halinde, çalışanların güvenlikle ilgili paylaşılan değerleri de yönetimin politika ve önceliğinde beyan ettiği şekilde oluşur. Yöneticilerin tutum ve davranışlarının firmanın uygun beyan edilmiş güvenlik politikası ve önceliğine rağmen buna zıt olarak gerçekleşmesi ise, çalışanların tutum ve davranışlarını da olumsuz olarak etkileyebilir (Rundmo ve Hale, 2003). Mattila ve Lepistö (1985)'nün araştırmalarında da bu görüş desteklenmekte ve güvenlik ile ilgili amaçlara işletme yönetiminin iş güvenliğine bağlı olması ve aktif şekilde güvenlik faaliyetlerinde bulunması halinde daha etkin bir şekilde ulaşılabileceği ifade edilmektedir. Fernandez-Muniz vd. (2007:636) ile Aksorn ve Hadisukumo (2008:725)'nün araştırmalarına göre yönetimin İSG bağlılığı ve

İSG faaliyetlerine katılımı, işyerinin İSG performansını etkileyen önemli bir unsur olarak ortaya konmuştur.

3.METODOLOJİ

Veri toplama yöntemi olarak anket tekniği kullanılmıştır. Bu araştırmada deneysel olmayan, kesitsel, nicel araştırma deseni kullanılmıştır. Katılımcılara yönetimin güvenlik bağlılığını temsil eden 10 soru yöneltilmiştir. Bir büyükşehir belediyesinin su ve kanalizasyon işlerini icra eden 500 çalışana anket formları dağıtılmış, geri dönen 465 anketten 455'inin geçerli olduğu tespit edilerek analize geçilmiştir.

Yönetimin güvenlik bağlılığını ölçen sorulardan Mearns, Whitaker ve Flin (2003)'in güvenlik kültürü ölçeğinden, ikisi Muniz, Peon ve Ordas (2007)'in güvenlik kültürü ölçeğinden, ikisi Carder ve Ragan (2003)'in güvenlik kültürü ölçeğinden, üçü ise Wu, Chen ve Li (2008)'in güvenlik kültürü ölçeğinden alınmıştır.

4.BULGULAR

Taşeronluk durumunun YGB üzerine etkisi (H_0) "Belediye çalışanlarında alt işveren çalışanlarının YGB algısı ile asıl işveren (belediye) çalışanlarının YGB algısı arasında farklılık yoktur" hipotezi ile test edilecektir. Hipotez testi Bağımsız Örneklem t Testi ile yürütülecektir. Bağımsız değişken taşeronun çalışması olma/olmama halini içeren dichotomus değişken iken, bağımlı değişken YGB'yi ifade eden (beşli Likert) polytomous değişkendir. Bağımsız örneklem t testi sonuçları Tablo 1'de görülmektedir.

Tablo 1. Taşeronluk Durumunun YGB ile İlişkisi

| | Gruplar | N | Ortalama | S.S. | t | df | p |
|-------------------|---------|-----|----------|---------|--------|--------|-------|
| Taşeronluk Durumu | Evet | 23 | 3,9043 | 0,38433 | -2,197 | 32,176 | 0,035 |
| | Hayır | 387 | 3,7108 | 0,72395 | | | |

Tablo 1'e göre alt işverenin çalışanlarının YGB algısı asıl işverenin çalışanlarına göre daha yüksektir. Gruplar arasındaki bu farklılık istatistiksel olarak anlamlı düzeydedir ($p=0,035<0,05$). Buna göre büyükşehir belediyesi özelinde taşeron firma çalışanların YGB algısı, belediyenin kadrolu çalışanlarının YGB algılarından istatistiksel olarak anlamlı derecede daha yüksektir. Bu bulgu H_0 hipotezinin reddini gerektirmektedir.

H_1 : Belediye çalışanlarında alt işveren çalışanlarının YGB algısı, asıl işveren (belediye) çalışanlarının YGB algısından daha yüksektir.

Asıl işveren işçileri ile alt işveren işçilerinin asıl işverenin işyerinde birlikte çalışması nedeniyle, tekli bir örgütsel yapıda, iki farklı çalışma grubu mevcuttur. Pozitif bir YGB algısı için, her iki grubun da YGB algısı yüksek olmalıdır. İşyerinde ancak bu halde, İSG'ye ve güvenlik kültürüne katkı sağlanabilir.

Grupların ortalamaları değerlendirildiğinde, her ikisinin de “yüksek” düzeyde olduğu görülmektedir.

Arpat'ın metal sektöründe yaptığı araştırmada asıl işveren işçileri ile alt işveren işçileri arasında YGB açısından istatistiksel olarak anlamlı bir farklılığa rastlanmamıştır. Bu bulgu ile araştırmamızın yukarıda açıklanan bulgusu kıyaslandığında, kamu işyerlerinde çalışan alt işveren işçilerinin YGB açısından özel sektör alt işvereni işçilerine göre daha pozitif YGB algılarına sahip olduğu söylenebilir. Kamu işverenlerinin alt işveren işçileri ile ilgili 6331 sayılı İSG kanunu ve diğer mevzuattan kaynaklı yükümlülüklerini özel sektörün asıl işverenlerine göre daha etkin olarak yerine getirmeleri ve/ya da güvenlik bağlılığını daha görünür ve güçlü ifade etmelerinden kaynaklanabilir. Çalışan açısından değerlendirildiğinde ise işverenin bağımlı çalışan bu kişilerin yasa, yönetmelik ve sözleşmeden kaynaklı çalışma ilişkisine dayanan haklarına titizlik göstermesi ve zamanında yerine getirmesi, bu kişilerin belediyeye karşı örgütsel bağlılıklarının yüksek düzeyde olması, İSG konusundaki yönetsel eylemleri herhangi bir özel sektör işyerine göre daha yeterli görmeleri, bu algının nedeni olabilir.

Bilindiği gibi, kamuda görev yapan taşeron firma çalışanlarının, çalıştıkları Kurumların kadrosuna mal edilmesi için mevzuat çalışması yapılmaktadır. Bu tip bir düzenlemenin gerçekleşmesi halinde, İSG açısından bu çalışanların kısa sürede Kurumlarına adapte olabileceği, yüksek örgütsel bağlılıkları ve pozitif YGB algısı ile pozitif güvenlik kültürü oluşumuna katkı sağlamaları beklenmektedir.

5.SONUÇ

Alt işveren işçilerinin YGB algıları, belediyeye doğrudan bağlı olarak çalışan kişilerin YGB algılarından daha yüksektir. İşverenin bağımlı çalışan bu kişilerin mevzuat ve sözleşmeden kaynaklı haklarını titizlikle ve zamanında yerine getirmesi, bu kişilerin belediyeye karşı örgütsel bağlılıklarının yüksek düzeyde olması, İSG konusundaki yönetsel eylemleri herhangi bir özel sektör işyerine göre daha yeterli görmeleri, bu algının nedeni olabilir.

KAYNAKÇA

Aksorn, T., Hadisukumo, B.H.W. (2008) “Critical Success Factors Influencing Safety Performance Program In Thai Construction Projects”, Safety Science, 46(4): 707-727.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Bakır, O. (2016) “Bir Yılan Hikâyesi Ve Kadro Masalında Sona Doğru: Bir Truva Atı Olarak “Özel Sözleşmeli Personel”.” Ankara Üniversitesi Sbf Dergisi 71(3).
- Carder, B., P. W. Ragan (2003) “A Survey-Based System For Safety Measurement And Improvement”, Journal Of Safety Research. 34: 157-165.
- Fernandez-Muniz, B., Montes-Peon, M.J., Vazques-Ordas, J.C. (2007) “Safety Culture: Analysis Of The Casual Relationships Between Its Key Dimensions”, Journal Of Safety Research, 38(6):627-641.
- İzgi, M. C. And H. Ö. Türkmen (2012) “Akdeniz Üniversitesi’nde Taşeron Sağlık İşçilerinin İşçi Sağlığı Ve İş Güvenliği Durum Tespiti.”, Türkiye Halk Sağlığı Dergisi 10(3).
- Mattila, M., Lepistö, J. (1985), Accident Prevention-A Survey Of The Current Performance, Report From The Workshop Effectivering Av Olycksfallsbekampning.
- Min, K. B., S.G. Park, J.S. Song, K.H. Yi, T.W. Jang, J.Y. Min (2013). “Subcontractors And Increased Risk For Work-Related Diseases And Absenteeism.” American Journal Of Industrial Medicine 56.
- Mearns, K., S. M. Whitaker, R. Flin (2003) “Safety Climate, Safety Management Practise And Safety Performance İn Offshore Environments”, Safety Science, Sayı: 41.
- Muniz, B. F., J. M. M. Peon, C. J. V. Ordas (2007) “Safety Culture: Analysis Of The Casual Relationships Between Its Key Dimensions”, Journal Of Safety Research, 38: 627-641.
- Özkan, Y., B. Arpat (2018). “Yönetici Perspektifinden Yönetim Kademelerinde İş Güvenliği İlgisi Ve Bağlılığı: Denizli İli Metal Sektöründe Bir Uygulama”. Ekrem Erdoğan (Ed), Sakarya Üniversitesi, Çeei, Seçme Yazılar-2 İçinde Sakarya Yayınevi, Sakarya, 263-298.
- Rundmo, T., A. R. Hale (2003), “Managers’ Attitudes Towards Safety And Accident Prevention”, Safety Sciences, 41: 557-574.
- Ulukan, N. C. Ve D. Ö. Yılmaz (2016) “Kamu Sağlık Sektöründe Çalışan Taşeron Kadın İşçiler: Samsun Ve Ordu İli Örneği.” Çalışma Ve Toplum Dergisi(1).
- Yasım, O.K. (2018). “Taşeron (İşçileri) Taş Taşısın: Belediye İşçileri Örneği”, İş-Güç Dergisi, 20 (I3): 279-291, Doi: 10.4026/İsguc.473616.

**MESLEK YÜKSEKOKULLARINDA UYGULANAN İŞBAŞI EĞİTİMLERİNDE YAŞANAN
SORUNLAR VE ÇÖZÜM ÖNERİLERİ**

Bülent Arpat*

Yeliz Yeşil**

Mehmet Levent Kocaalan***

ÖZET

Meslek yüksekokullarında (MYO) işbaşı eğitimleri, öğrencilere alan ile ilgili uygulama yetkinliği kazandırmak amacıyla işyeri ortamında uygulanan öğretim yöntemlerinden biridir. Günümüzde hızla yayılmakta olan işbaşı eğitimleri, “uzun süreli çalıştırma” ortak paydasında çeşitli modellerde uygulanabilmektedir. Bu araştırmanın amacı MYO’larda uygulanan işbaşı eğitimlerinde yaşanan sorunları çözüm önerileri ile birlikte ele alarak iyi uygulamaların gerçekleştirilebilmesine/iyileştirilebilmesine/geliştirilebilmesine katkı sağlamaktır. İşbaşı eğitimlerinde yaşanan sorunlar öğrenci seçiminde karşılaşılan problemler, uygulama ile ilgili problemler, işyeri seçimi (yerleştirme) ile ilgili problemler, işyerlerinin öğrenci tercihi ile ilgili problemler, denetim problemleri, öğrenci ile işyerini eşleştirme problemleri, uygulamayı kredileme problemleri, ölçme ve değerlendirme problemleri, ücretlendirme ve teşvik ile ilgili problemler, yapılan iş ile öğrenim görülen program arasındaki uyumsuzluktan kaynaklanan problemler olarak gruplandırılmıştır. Araştırmanın sonuçlarına göre, ancak mevcut sorunların çözümü halinde programdan umulan faydaların bütünüyle elde edilebileceği değerlendirilmektedir.

Anahtar Kelimeler: İşbaşı Eğitimi, Meslek Yüksekokulu, Mesleki Eğitim.

JEL Kodları: I25, J21, J62

* Dr.Öğr.Üyesi, Pamukkale Üniversitesi, barpat@pau.edu.tr, Denizli, Türkiye.

** Dr.Öğr.Üyesi., Trakya Üniversitesi. yelizyesil@trakya.edu.tr, Edirne, Türkiye.

*** Öğr.Gör., Pamukkale Üniversitesi, mlkocaalan@pau.edu.tr, Denizli, Türkiye.

PROBLEMS AND SOLUTION OFFERS RELATED TO JOB TRAINING APPLIED IN THE VOCATIONAL SCHOOLS

ABSTRACT

On-the-job trainings in vocational schools (VS) are one of the teaching methods applied in the workplace environment in order to provide the students with practical competence in the branch. On-the-job trainings, which are spreading rapidly nowadays, can be applied in various models in the common share of "long-time working". The purpose of this research is to contribute to the implementation / improvement / development of good practices by considering the problems experienced during the on-the-job training applied in the VSs, together with the solution proposal. Problems in job training are problems encountered in student selection, problems related to application, problems related to workplace selection (placement), problems related to student preference, problems of inspection, problems of matching student and workplace, application of crediting problems, problems related to the incentive are grouped as problems arising from the inconsistency between the work done and the program seen. According to the results of the research, it is evaluated that in the solution of the existing problems, the benefits expected from the program can be obtained completely.

Keywords: *Occupational Health and Safety, Management Commitment on Safety, Subcontractor, Subcontracted Labour.*

JEL Codes: *I25, J21, J62*

1.GİRİŞ

Türkiye’de meslek yüksekokullarında (MYO) işbaşı eğitimi modeli, öğrencilerinin istihdam odaklı olarak yetiştirilmelerini sağlamak amacıyla geliştirilen ve piyasada uzun süreli çalıştırılmalarını içeren ve çeşitli biçimlerde uygulanan bir modeldir. Türk MYO’da uygulanan modeller aşağıda listelenmiştir (Özkan vd., 2016:279):

- 1 dönem işyeri uygulaması (3+1 modeli),
- Three master (3+3 modeli),
- 1 yıl işyeri uygulaması,
- Yarı zamanlı işyeri uygulaması (Sağlık MYO’lar kapsamında),
- Three master içinde 4+2 uygulaması.

İşbaşı eğitimi mezunların işsizlik sorununu çözmek yanında, çalışacakları işlerdeki eğitim - istihdam uyumlarını güçlendirmek, böylece hem işgücünün devir hızını düşürmek hem de mezunların eğitimlerine uygun iş bulmalarına katkı sağlamayı amaçlamaktadır. Zira, eğitimlerini tamamlayan meslek lisesi, MYO ve lisans mezunu gençler, vasıflı işgücünü temsil ettiklerini düşünerek ücret beklentilerini yüksek tutmaktadırlar. Ancak genç işçi ücretlerinin yetişkinlerden daha yüksek olduğu durumlarda, yetişkinleri istihdam etmek tercih edileceğinden, ücretlerin genç işsizliğine etkisi olumsuz olmaktadır (Çetinkaya, 2010:53). Mezunların yüksek ücret talebi, deneyimsizlik ile birleşince, iş hayatına girişte uzun süreli işsizlik ortaya çıkmakta ya da gençler ancak ikincil işgücü piyasalarında yüksek mobilite ile çalışma olanağı bulabilmektedir. Genç işçilerin mobilitesinin yüksekliği nedeniyle işverenler genç işçilerin eğitimleri için önemli bir harcama yapmayacak, bu da genç işçilerin daha iyi ücretle iş bulmak için işten ayrılanların nitelikli bir iş bulma şanslarını azaltacaktır (Çetinkaya, 2010:52). Genç işsizliğini arttıran ya da ikincil işgücü piyasalarında çalışmaya sevk eden bu sorun, yükseköğretim döneminde okul yıllarında işyeri ortamında yapılacak ve öğrencinin eğitim becerisini ve deneyimini arttırmaya odaklı eğitim-öğretim uygulamalarını cazip hale getirmektedir.

2.ARAŞTIRMANIN AMACI

Bu araştırmanın amacı MYO'larda uygulanan işbaşı eğitimlerinde yaşanan sorunları çözüm önerileri ile birlikte ele alarak iyi uygulamaların gerçekleştirilebilmesine/iyileştirilebilmesine/geliştirilebilmesine katkı sağlamaktır. İşbaşı eğitimlerinde yaşanan sorunlar öğrenci seçiminde karşılaşılan problemler, uygulama ile ilgili problemler, işyeri seçimi (yerleştirme) ile ilgili problemler, işyerlerinin öğrenci tercihi ile ilgili problemler, denetim problemleri, öğrenci ile işyerini eşleştirme problemleri, uygulamayı kredilendirme problemleri, ölçme ve değerlendirme problemleri, ücretlendirme ve teşvik ile ilgili problemler, yapılan iş ile öğrenim görülen program arasındaki uyumsuzluktan kaynaklanan problemler olarak gruplandırılmıştır.

3.YÖNTEM

Araştırmada doküman inceleme ve katılımlı gözlem yöntemleri kullanılmıştır. Bu yöntemler kullanılarak problemler tanımlanmış ve iyileştirme önerileri geliştirilerek aktarılmıştır. Doküman inceleme kapsamında literatürde daha önce MYO'larda işbaşı eğitimi için derlenmiş araştırmalar taranmıştır. İşbaşı eğitimini 3 yıldır fiili olarak uygulamakta olan bir MYO'nun tüm uygulamayı planlama, yerleştirme, denetim ve değerlendirme faaliyetlerinde aktif rol alınarak gözlem olanağı elde edilmiş ve bu yolla sorunların tespiti yapılmıştır.

4.BULGULAR

İşbaşı eğitimlerinde yaşanan sorunlar aşağıdaki başlıklar altında kategorize edilmiştir.

4.1.Öğrenci Seçiminde Karşılaşılan Problemler

Öğrenciler uygulamayı 2. yıllarının güz ya da bahar dönemlerinde yapabilmektedir. Ancak 1,80 genel başarı ortalamasını yakalayamayan öğrencilerin uygulama yapmasına izin verilmemektedir. MYO'larda öğrenci başarısının düşük olması nedeniyle bazı öğrencilerin ikinci yıllarında işyerine gönderilmesi mümkün olmamaktadır. 1,80 ortalama şartı öğrencinin mesleki uygulama yapabilmesi için belli bir teorik kapasiteye ulaşması gereğini ifade etmektedir. Ancak Arpat vd. (2017)'nin araştırmasında da görüldüğü üzere, öğrencilerin iş teklifi almasında teorik başarı düzeyleri etkili değildir. Buna göre işbaşı eğitimine başlamak için 1,80 ortalamasının kaldırılarak uygulanması önerilmektedir.

Öğrenci seçimi ile diğer problem, işyerlerinin belli cinsiyet, dış görünüm, tutum/davranış vb özellikte öğrencileri tercih etmeleridir. Bu durum bazı öğrencilere uygulama için işyeri olanağı bulunamamasına neden olmaktadır. 3308 sayılı yasaya göre bu durumdaki öğrencilerin okul ortamında çalıştırılmaları öngörülse de çok sayıda öğrenciye okul ortamında yaptırılması mümkün değildir. Özellikle engelli öğrencileri tercih eden işverenlere daha fazla katkılar sağlanması, bu tip bir istihdamı cazip hale getirebilir. Öğrencinin engeline uygun nitelikte ki işyerleri ya da Sosyal Hizmet Müdürlüklerinde uygulamanın yaptırılması da başka bir seçenek olabilir.

4.2.Öğrenci ile İşyerini Eşleştirme Problemleri

MYO'larında açılan programların yörenin sektörel dinamikleri ile işgücü taleplerine uygun olmaması, işbaşı yapacak öğrencilere uygun işyerleri bulunmasını zorlaştırmaktadır. Bu hallerde öğrenciler işbaşı eğitimi için iş-egitim uyumunun daha zayıf olduğu işyerlerine yönlendirilebilmektedir. Her ne kadar öğrencilere MYO'nun bulunduğu lokasyonun dışında uygulama yapma olanağı sağlansa da bu durum denetimleri zorlaştırmaktadır.

4.3.Ücretlendirme ve Teşvik ile İlgili Problemler

Öğrencilere işbaşı eğitimi sırasındaki iş görme faaliyetlerinin karşılığında, işveren tarafından ücret ödemesi yapılmalıdır. Ücret tutarları, işyerindeki çalışan sayısına göre belirlenmiştir. 20 ve üzerinde personel çalıştıran işyerleri asgari ücretin net tutarının %30'u, diğer işyerleri ise %15'i olacak şekilde minimum ücret ödemesi yapılmalıdır. Ödeme, sadece özel sektör işyerlerini kapsamakta olup uygulamayı kamuda yapan öğrencilere ödeme yapılmamaktadır. Bazı MYO programlarında maksimum düzeyde iş-egitim uyumunun sağlanması için kamu kurumlarında işbaşı eğitimini yapmak elzemdir. Bu programlara sosyal güvenlik ile infaz ve güvenlik hizmetleri örnek gösterilebilir. Bazı programlar da ise hem kamu işyerlerinde hem de özel sektör işyerlerinde öğrencinin maksimum fayda sağlaması mümkündür. Bu gruba örnek olarak da büro yönetimi ve yönetici asistanlığı programları verilebilir. Bu

nedenle ücretlendirme uygulamasının kamu kurumlarında çalıştırılan öğrencileri de kapsamı, uygulamanın yaygınlaştırılması açısından gereklidir

3308 sayılı yasaya göre işbaşı eğitimine dahil olan işyerlerine, öğrenciye ödenen ücretin bir kısmının devlet tarafından karşılanması yoluyla teşvik verilmektedir. Teşvik tutarı, işyerindeki çalışan sayısına endekslenmiştir. Yirmiden az çalışanı olan işletmeler için minimum ücretin 2/3'ü, yirmi ve üzerinde personel çalıştıranlar için 1/3'ü devlet katkısı olarak ödenmektedir. Bu katkının ödenmesi için ilk olarak -ilgili MYO birimi tarafından- işverenlerden talep toplanmakta, bu talepler Öğrenci İşleri Daire Başkanlığına (ÖİDB) iletilmektedir. ÖİDB aldığı talepleri YÖK'e iletmekte, YÖK tarafından tahakkuklar hesaplanarak Strateji Daire Başkanlığı üzerinden ödemenin sağlanması için ilgili tutar bu başkanlığa transfer edilmektedir. Strateji Daire Başkanlığı ise ilgili akademik birime fonun dağıtımını için parayı transfer etmekte, buradan ilgili işyeri hesaplarına transfer yapılmaktadır. Bu işlem adımlarının fazlalığı katkının işverene ödeme süresini uzatmakta ve cazibesini ortadan kaldırmaktadır. Hatta bazı işverenlerin sonradan alacakları bu katkı tutarlarını, öğrencinin ücretlerinden kestiği yönünde geri bildirimler alınmaktadır. Bu sorunun ortadan kaldırılması için işlem adımları azaltılmalı, ödeme süresi kısaltılmalıdır. Hatta bu katkının işverenlere devlet tarafından yapılan diğer ödemelere eklenerek otomatize edilmesi, uygulamayı daha cazip hale getirebilir. Bu tip bir iyileştirme, işbaşı eğitimlerinin yurt sathında bilinirliğinin artırılması ve öğrenci talebinin yaygınlaştırması için önemli katkılar sağlayabilir.

5.SONUÇ

MYO'larda işbaşı eğitimleri, mezunların niteliklerinin artırılarak istihdama geçişlerinin kolaylaştırılmasını sağlayan güncel ve önemli uygulamalardan biridir. Uygulama MYO'lar içinde zaman ve uygulama esasları açısından farklılaşmaktadır.

İşbaşı eğitimine gönderilecek sorunların çözümü için, öğrencilerden beklenen 1,80'lik genel başarı ortalama şartı kaldırılmalıdır. Başarı düzeyi çok düşük olan öğrenciler, yeterli kredileri olmamaları nedeniyle zaten buna hak kazanamayacakken böyle bir kriterin varlığı, piyasaya gönderilen öğrenci sayısını azaltmaktadır. Bu durum öğrencilerin eğitimlerini yarıda bırakmalarına ya da öğrenim sürelerinin boş yere uzamasına neden olmaktadır.

İşyerlerince tercih edilmeyen dezavantajlı öğrencilere de fırsat eşitliği sağlamak önem arz etmektedir. Bunun için yapılacak mevzuat düzenlemeleri ile bu kişilere hem rehabilite imkânı sağlayacak hem de pratik bilgi edindirecek kamu kurumu ya da daha fazla teşvik sağlanmış özel sektör işyerleri olabilir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

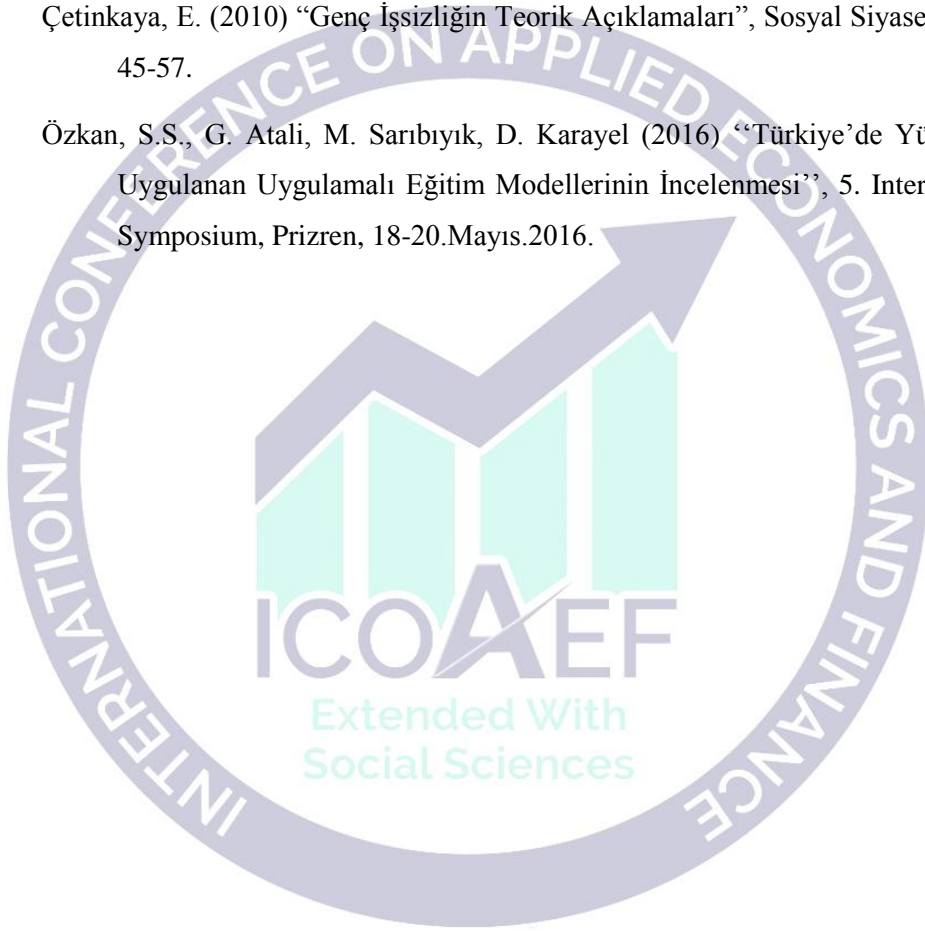
İşyeri teşviklerinden faydalanabilmek için mevcut geri ödeme prosedüründe ödeme süresini kısaltacak iyileştirmeler yapılmalıdır.

KAYNAKÇA

Arpat, B., M. Tokbaş, B. Çamurdan, A. Akşit (2017) “Meslek Yüksekokullarında 3+1 Eğitim Modeli Stajlarında Yapılan İş Teklifleri Üzerine Bir Araştırma: Honaz Meslek Yüksekokulu Örneği”, International Journal of Academic Value Studies, 3 (14): 1-11.

Çetinkaya, E. (2010) “Genç İşsizliğin Teorik Açıklamaları”, Sosyal Siyaset Konferansları Dergisi, 58: 45-57.

Özkan, S.S., G. Atali, M. Sarıbyık, D. Karayel (2016) “Türkiye’de Yükseköğretim Kurumlarında Uygulanan Uygulamalı Eğitim Modellerinin İncelenmesi”, 5. International Vocational School Symposium, Prizren, 18-20.Mayıs.2016.



**MESLEK YÜKSEKOKULLARINDA VERİLEN GİRİŞİMCİLİK DERSLERİNİN
GİRİŞİMCİLİK EĞİLİMİNE ETKİSİ ÜZERİNE BOYLAMSAL BİR ARAŞTIRMA**

Bülent ARPAT*

Yeliz YEŞİL**

Mehmet Levent KOCAALAN***

ÖZET

Günümüzde girişimcilik kavramı giderek yaygınlaşmaktadır. Ülkelerin kalkınmasında girişimci bireylerin yetişmesi önemli hale gelmiştir, bu sebeple girişimcilik kabiliyeti gelişmiş bireylerin eğitim kurumlarında yetişmesini desteklemek gerekmektedir. Girişimciliğin gelişmesiyle birlikte istihdam olanakları da artmakta ve gelişmektedir. Bu çalışmanın amacı Meslek Yüksekokullarında verilen girişimcilik derslerinin girişimcilik eğilimine etkisi üzerine boylamsal bir değerlendirme yapmaktır. Yapılan çalışmanın sonuçlarına göre de MYO'da girişimcilik dersi almak ile öğrencinin kendi işini kurabilme düşüncesi arasında istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki bulunmamaktadır. MYO'da verilen girişimcilik dersleri, öğrencilerin kendilerini kurma üzerinde pozitif bir etki oluşturmamaktadır.

Anahtar Kelimeler: Girişimcilik, Mesleki Eğitim, Meslek Yüksekokulu, Eğitim.

JEL Kodları: A22, I25, J21.

**THE MATTER OF ENTREPRENEURSHIP TENDENCY IN TURKEY: THE
ENTREPRENEURSHIP IN THE FRAMEWORK OF AN APPLICATION LONGITUDINAL
VOCATIONAL SCHOOL COURSES**

ABSTRACT

Today, the concept of entrepreneurship is becoming more widespread. The development of entrepreneurial individuals has become important in the development of countries, so it is necessary to support the development of individuals with entrepreneurial skills in the educational institutions. According to the results of the study, there isn't a statistically significant relationship between taking entrepreneurship course in Vocational High School and the idea of establishing the student's own business. Entrepreneurship courses given at the vocational school cannot be said to have a positive effect on students' own business.

* Pamukkale Üniversitesi, barpat@pau.edu.tr, Denizli, Türkiye

** Trakya Üniversitesi - İİBF – ÇEEİ, yeliz_yesil@trakya.edu.tr

*** Pamukkale Üniversitesi, Honaz MYO, mlkocaalan@pau.edu.tr

1. GİRİŞİMCİLİK KAVRAMI VE EĞİTİMİ

Coulter (2001)' e göre girişimcilik bireyin veya bir grup bireyin, inovasyon yoluyla istek ve ihtiyaçları yerine getirerek değer yaratma ve büyümeye yönelik fırsatları sürdürme çabalarını ve araçlarını kullandığı süreçtir. Ayrıca, Hisrich, Petern ve Shepherd (2008) girişimciliği; zaman ve çaba harcayarak, finansal risk, fiziksel ve sosyal riskler alarak yeni bir şey yaratma süreci olarak tanımlamaktadır (Kusmintarti vd., 2018: 1528).

Girişimcilik insanların düşündüklerinin, hayalini kurduklarının, gerçekleşmesini arzu ettiklerinin önündeki engellere takılmadan büyük bir özveri ve kararlılıkla hayata geçirme, hayalden, fikir olmaktan çıkarma ve reel hayatta uygulamaya alma eylemi olarak tanımlanabilmektedir (Güner, 2010: 9).

Girişimciliğin en önemli kişisel özellikleri; risk içeren kararlar alabilme hem yaratıcı hem de atılgıncı bir kişilik yapısına sahip olma, ileriye görme ve geleceği tahmin etme, başkalarının bakıp göremediklerini fark edebilme, etkin bir liderlik yapabilme ve pozitif cesarettir. Girişimci daha önce bulunmayan bir şeyi ortaya çıkarmak onun en büyük amacıdır. Girişimciyi farklı kılan, yalnızca düşünmeyen, fikirlerini kâğıt üstünde bırakmayan, “eylem”i seçen kişi olmasıdır (Fidan ve Yeşil, 2015:320).

Shane ve Venkataraman (2000) ve Oosterberbeek, Praag ve Ijsselstein (2010)'a göre girişimcilik faaliyeti ile ekonomik büyüme ve yenilik gibi ekonomik sonuçlar ve ekonomik verimlilik yaratmak, yeni işler yaratmak arasında güçlü bağlar vardır. Günümüzde hükümetler ve üniversiteler tarafından düzenlenen girişimcilik eğitimine karşı artan bir ilgi vardır (Yarkın ve Yeşil,2016:128).

Girişimcilik eğitiminin temel amacı kişilerin kendi işini kurarak bağımsız çalışmalarını sağlamaktır. Girişimcilik eğitim programlarının amacı ise kişilerin kendi iş yerlerini kurmaları için, gerekli temel girişimcilik ve işletmecilik bilgilerini vererek, özel sektöre geçişlerini kolaylaştırmak ve bu işleri başarıyla yürütmelerini sağlamaktır (Patır ve Karahan, 2010:27).

2. LİTERATÜR TARAMA

Bozkurt ve Alparslan (2013)'ın yaptıkları çalışmada, günümüzde girişimci özelliklerinin ne olması gerektiği ve üniversitelerdeki girişimcilik eğitiminin nasıl olması gerektiğine yönelik hem girişimcilerin hem de öğrenci görüşlerinin belirlenmesi amaçlanmıştır. Bu amaç doğrultusunda 58 girişimci ile yarı yapılandırılmış görüşmeler yapılmıştır. Girişimcilerden alınan görüş ve öneriler 125

öğrenciye anket yöntemi ile yöneltilmiş ve girişimcilerin görüş ve önerilerine katılıp katılmadıkları tespit edilmeye çalışılmıştır. Bulgulara göre; girişimcilerin vurguladıkları ilk 4 girişimci özellik (özgüven, dürüstlük, risk alma, yenilikçi düşünme) öğrenciler tarafından da önemsenen ilk 5 özellik arasında yer almıştır. Ancak girişimcinin önemli olduğunu vurguladığı sosyal olma özelliği ilk 5 özellik içinde yer almamış hatta bu özelliği en son sırada belirtmişlerdir. Girişimcilerin, girişimcilik dersi ile ilgili olarak sırasıyla; “teorikten ziyade uygulama, girişimcilerin derslere daveti, öğrencilerin cesaretlendirilmesi ve girişimcilik özelliklerinin kazandırılması” önerileri yer almıştır. Öğrenciler bu önerilere çoğunlukla katılmakla birlikte, dersi veren akademisyenlerin yeterliliğini, kendilerine girişimci özellikleri kazandırılmasına yönelik eğitimi, ilgi duyulan alanlara yoğunlaşma imkânının sağlanmasını, başarılı girişimcilerin derslere davetini ve uygulamalı projelere yönelik çalışmaların yapılmasını daha fazla önemsemişlerdir.

Korkmaz (2012)'ın yaptığı çalışma, Bülent Ecevit Üniversitesi, işletme bölümü öğrencilerinin girişimci bir kişiliğe sahip olup olmadıklarını tespit etmek ve girişimcilik eğilimlerinde etkili olan psikolojik, demografik ve aile faktörlerinin neler olduğunu belirlemek amacıyla yapılmıştır. Bu amaçla Bülent Ecevit Üniversitesi, işletme bölümü öğrencilerine anket formu uygulanmıştır. Yapılan istatistikî analizler sonucunda öğrencilerin kendilerini girişimci bir kişiliğe sahip görmelerinde ve gelecekte iş kurma isteklerinde etkili olan psikolojik, demografik ve aile özellikleri arasında anlamlı ilişkiler elde edilmiştir. Bu sonuca göre Bülent Ecevit Üniversitesi İşletme Bölümü öğrencilerinin girişimci bir kişiliğe sahip olduklarını söylemenin mümkün olduğu belirtilmiştir.

Doğaner ve Altunoğlu (2010:103)'nun yaptıkları çalışmanın amacı diğer bölümlere göre daha yoğun girişimcilik eğitimi alan üniversite öğrencilerinin girişimcilik eğilimlerini etkileyen faktörleri ortaya koymaktır. Örneklem olarak İşletme Bölümü öğrencileri alınmıştır. Çalışmada girişimcilik eğiliminin cinsiyet, eğitim durumu, girişimcinin donanımsal hazırlığının olup olmaması ve kişilik özelliklerinden etkilenebileceği öngörülmüştür. 229 adet öğrenciden elde edilen anketlere uygulanan analizler sonucunda erkek öğrencilerin kız öğrencilere göre girişimcilik eğilimlerinin daha fazla olduğu ortaya konulmuştur. Fakat öğrencilerin eğitim düzeyleri ile girişimcilik eğilimleri arasında anlamlı bir ilişki ortaya konamamıştır. Kişilik özellikleri dikkate alındığında girişimcilik eğilimi ile yaratıcılık ve başarı arzusu arasında pozitif bir ilişki tespit edilmiştir.

Güreşçi (2014:23)'nin yaptığı çalışmada, Atatürk Üniversitesi İspir Hamza Polat MYO Büro Yönetimi ve Sekreterlik Bölümü 2. Sınıf öğrencilerinin girişimcilik eğilimlerinin tespiti amaçlanmıştır. Çalışma, 2008-2009 2. yarıyıl döneminin son haftası ve son saatinde gerçekleştirilmiştir. 33 sorudan oluşan anketler söz konusu öğrencilere uygulanmış ve öğrencilerin girişimcilik eğilimleri verdikleri (Evet) cevap sayısına göre potansiyel girişimci olarak değerlendirilmiştir

Balaban ve Özdemir (2008:133) yaptıkları çalışmada, öncelikle kavramsal olarak girişimcilik, girişimcilerin özellikleri ve girişimcilik eğitimi üzerinde durulmuş ve daha sonra işletme öğrencilerinin girişimcilik eğilimlerini etkileyen faktörleri ve bu eğilimler ile girişimcilik eğitimi/dersi arasındaki ilişkileri belirlemeye yönelik olarak nicel ve nitel araştırma yöntemleri kullanılmıştır. Çalışmadan elde edilen bu bulgular doğrultusunda eğitim ve özel anlamda girişimcilik eğitimi, girişimcilik eğiliminin ortaya çıkmasında gerek şart olmasına karşılık yeter şart olarak değerlendirilmemektedir.

Solmaz vd. (2014: 41)'nin yaptığı araştırmanın amacı, turizm eğitimi alan lisans ve ön lisans öğrencilerinin girişimci kişilik özelliklerinin tespit edilmesidir. Bu amaçla, Sakarya Üniversitesi ve Abant İzzet Baysal Üniversitesi'nde turizm eğitimi alan 308 lisans ve ön lisans öğrencisi üzerinde bir alan araştırması gerçekleştirilmiştir. Araştırmadan elde edilen veriler istatistikî metotlarla analiz edilmiştir. Araştırma sonucu elde edilen bulgular, turizm öğrencilerinin girişimci kişilik özelliklerine önemli ölçüde sahip olduklarını göstermiştir. Ayrıca, girişimci kişilik özellikleri bakımından lisans ve ön lisans öğrencileri arasında anlamlı bir farklılık olduğu tespit edilmiştir.

Kılıç vd. (2012), yaptıkları çalışmada potansiyel girişimciler olan üniversite öğrencilerinin girişimcilik özellikleri belirlenmeye çalışılmıştır. Bu bağlamda önce girişimcilik, girişimci ve üniversite öğrencisi kavramları açıklanmış daha sonra yer alan uygulama kısmında ise Balıkesir Üniversitesi Bandırma İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi İşletme Bölümü öğrencileri üzerinde bir uygulama yapılmıştır. Uygulamada Yılmaz ve Sünbül'ün geliştirmiş olduğu ölçek kullanılmıştır. Araştırma sonucunda üniversite öğrencilerinin yenilik özellikleri ile cinsiyetleri arasında anlamlı bir farklılık vardır ve erkek öğrenciler kız öğrencilere göre daha yenilikçi bir yapıya sahiptirler. Öğrencilerin aylık gelirleri ile yenilik, kendine güven, risk alma, dışa açıklık, başarıya inanma özellikleri arasında anlamlı bir ilişki vardır ancak öğrencilerin aylık gelirleri ile fırsatçılık özelliği arasında anlamlı bir ilişki yoktur.

Türkmen ve İşbilir (2014:18)'in yaptıkları araştırmanın bulgularına göre, cinsiyet, okuldaki sınıfı, ailenin yaşadığı yer, annenin çalıştığı sektör, ailenin aylık geliri, okul sonrası kariyer planları, iş tecrübesi, girişimcilik eğitimi alma değişkenlerine göre öğrencilerin girişimcilik eğilimleri arasında farklılık tespit edilmiştir. Yaş, kardeş sayısı, babanın çalıştığı sektör, 1 milyon Türk Lirasını (TL) kullanma alanı ve daha önce girişimcilik faaliyetinde bulunma değişkenlerine göre ise öğrencilerin girişimcilik eğilimleri arasında bir farklılık bulunamamıştır.

3. METODOLOJİ

3.1 Araştırmanın Amacı ve Önemi

MYO'larda verilen girişimcilik derslerinin temel amacı öğrencilere bir girişimcide bulunması gereken nitelikleri kazandırmak ve girişimcilik eğilimine sahip olmalarını sağlamaktır. Bu niteliği

kazanan öğrenciler için aranan becerilerden birisi, öğrenciler mezun olduktan sonra kendi işlerini kurabilmeleri ve işgücü piyasalarına daha kısa zamanda ve daha kolay erişim sağlama ile daha avantajlı çalışma koşullarına sahip olabilmeleridir.

Bu araştırmanın amacı; girişimcilik dersini başaran MYO öğrencilerinin bir girişimcide bulunması gereken nitelikleri kazanıp kazanmadığını değerlendirmektir. Bu çerçevede, araştırmanın problem cümlesi “MYO’larda verilen girişimcilik dersleri, öğrencilere girişimcilik nitelikleri kazandırmakta ve girişimcilik eğilimlerini arttırmakta mıdır?” olarak belirlenmiştir.

Araştırma sonuçları özellikle MYO mezunları başta olmak üzere yükseköğretim mezunlarında ortaya çıkan yüksek oranlardaki işsizlik ile mücadeleye sağlayacağı katkı açısından önemlidir. Girişimcilik dersi öncesi ve sonrası yapılacak ölçümlerle derlenecek sonuç ve önerileri, mezunların girişimcilik niteliklerinin artırılarak iş fikirlerini icra etmek suretiyle istihdama katkı sağlaması beklenmektedir. Bu durum ayrıca, refah artışı sağlayarak ekonomik büyümeyi hızlandırma potansiyeline de sahiptir.

3.2 Araştırmanın Yöntemi

Meslek yüksekokullarında girişimcilik dersini alanların, girişimcilik eğilimine etkisini incelemek için, Konakay (2017) ve Bilge ve Bal (2012)’nin geliştirdiği ölçekten faydalanılmıştır. Veri toplama amacıyla, anket yöntemi kullanılmıştır. Anket iki bölümden oluşmaktadır. Birinci bölümde, öğrencilere girişimcilik eğilimi/niteliği kazanma ile ilgili beşli Likert cevap bileşeni içeren 22 soru yöneltilmiştir. 2. bölümde ise, öğrencilerin demografik özelliklerini belirlemeye yönelik, 12 sorudan oluşturulmuş bir soru seti yöneltilmiştir. Uygulama, öğrencilere araştırma hakkında bilgi verildikten sonra, anketin dağıtılıp toplanması ile icra edilmiştir.

Girişimcilik derslerinin etkisinin değerlendirildiği araştırmada, boylamsal araştırma yöntemlerinden, yarı deneysel teknikler ile yürütülmüştür. Girişimcilik dersini almayan MYO programlarından seçilen öğrenciler kontrol grubunu oluşturur iken, girişimcilik dersini alan programlardan bu dersi başarıyla tamamlaması nedeniyle seçilen öğrencilerde deney grubunu oluşturmaktadır. İki grup arasındaki müdahale durumu, girişimcilik dersini almak ve dersten geçmek olarak belirlenmiştir.

Uygulama öncesi her iki grup için belirlenen ve 150’şer kişiden oluşan iki gruba anket uygulanmıştır. Geçersiz anketler çıkarıldığında deney grubunda 102, kontrol grubunda 139 geçerli anket elde edilmiştir.

4. BULGULAR

4.1 Güvenilirlik Testi

Güvenilirlik, ölçme aracının ölçtüğü özellikleri, her zaman aynı şekilde ölçüp ölçemediğinin önemli bir göstergesidir (Tekin, 2009:57). Cronbach's Alpha iç tutarlılık güvenilirlik katsayısı, Likert tipi ağırlıklı puanlamanın yapıldığı araçlarda, maddelerin iç tutarlılığını tahmin etmede kullanılır (Okursoy ve Turan, 2014:71). Güvenilirlik analizi "girişimcilik dersi alan" çalışma grubu ile "girişimcilik dersi almayan" çalışma grubuna ait veri setlerinde ayrı ayrı icra edilmiştir. Güvenilirlik analizleri sonucunda elde edilen Cronbach's Alpha değerleri Tablo 1'de görülmektedir.

Tablo 1. Girişimcilik Dersi Alan ve Almayan Gruplarda Cronbach's Alpha Skorları

| Dersi Almayanlar | | Dersi Alanlar | |
|------------------|------------------|------------------|------------------|
| Cronbach's Alpha | Katılımcı Sayısı | Cronbach's Alpha | Katılımcı Sayısı |
| 0,909 | 101 | 0,905 | 136 |

Tablo 1'e göre her iki grupta Cronbach's Alpha skorları 0,80 değerinden büyüktür. Cronbach's Alpha katsayısı 0,80 ile 1 aralığında yer alan testler yüksek güvenilirliğe sahiptir (Alpar, 2011). Cronbach's Alpha katsayısının verilen aralıkta olmasından dolayı anketlerden elde edilen verilere istatistiksel analizler uygulamanın mümkün olduğu sonucuna ulaşılmıştır.

4.2. Çıkarımsal Analiz Bulguları

MYO'da öğrencilere verilen Girişimcilik dersinin girişimcilik eğilimleri üzerine etkisi, maddelerden elde edilen grup ortalamaları verileriyle icra edilmiştir. Bu kısımda dersi almayan öğrencilerin ortalamaları ile dersi alan öğrencilerin ortalamaları karşılaştırılmıştır. Karşılaştırma Paired Samples T Test ile yapılmıştır. Test sonuçları Tablo 2'de görülmektedir.

Tablo 2. Girişimcilik Dersinin Girişimcilik Eğilimi Üzerine Etkisi

| | Mean | S.D. | t | df | p |
|------------------|--------|--------|--------|-----|------|
| Dersi Almayanlar | 3,8820 | ,57284 | -1,225 | 100 | ,223 |
| Dersi Alanlar | 3,9836 | ,59474 | | | |

Tablo 2'ye göre girişimcilik dersi alanlar ile almayanlar arasında istatistiksel olarak anlamlı bir farklılık olmadığı anlaşılmaktadır ($p=0,223>0,05$). Girişimcilik dersi alanların ortalaması, dersi almayanlara göre bir miktar fazla olsa da bu farklılık tesadüfi olarak ortaya çıkmaktadır. Bu skora göre MYO düzeyinde verilen girişimcilik derslerinin, öğrencilere girişimcilik ile ilgili nitelikleri kazandır(a)madığı ya da girişimci bir kimlik kazandırmada etkili olmadığını söylemek mümkündür.

5.SONUÇ VE DEĞERLENDİRME

Girişimcilik günümüzde birçok ülkenin önemini kavradığı ve bu alanda çalışmalarını arttırdığı bir faaliyettir. Girişimciliğe yönelik eğitim faaliyetleri giderek yaygınlaşmakta ve üniversitelerde girişimciliğe yönelik eğitimlerin arttığı görülmektedir. Üniversitelerdeki gençlerin girişimcilik eğilimini ölçmeye yönelik araştırmalar; gençlerin girişimcilik eğilimine sahip olduklarını ve girişimcilik konusunda yönlendirilebileceklerini ortaya koymaktadır.

Özellikle eğitimin rolü birçok alanda olduğu gibi bireyleri girişimcilik alanında da geleceğe hazırlamada önemlidir. Girişimcilik eğitiminin hangi amaçla verildiği, sadece ders olarak kredi tamamlaması için değil, dersin verilmesinin amacı ve önemi gençlere kavratılmalı ve aynı zamanda öğrencilere güncel gelişmeleri yakalamaları için teorik bilgi yanında uygulama imkânı da verilmelidir. Örneğin; Bozkurt ve Alparşlan (2013)'ın yaptıkları çalışmada, günümüzde girişimci özelliklerinin ne olması gerektiği ve üniversitelerdeki girişimcilik eğitiminin nasıl olması gerektiğine yönelik hem girişimcilerin hem de öğrenci görüşlerinin belirlenmesi amaçlanmıştır. Bulgulara göre; girişimcilerin vurguladıkları ilk 4 girişimci özellik (özgüven, dürüstlük, risk alma, yenilikçi düşünme) öğrenciler tarafından da önemsenen ilk 5 özellik arasında yer almıştır. Ancak girişimcinin önemli olduğunu vurguladığı sosyal olma özelliği ilk 5 özellik içinde yer almamış hatta bu özelliği en son sırada belirtmişlerdir. Girişimcilerin, girişimcilik dersi ile ilgili olarak sırasıyla; “teorikten ziyade uygulama, girişimcilerin derslere daveti, öğrencilerin cesaretlendirilmesi ve girişimcilik özelliklerinin kazandırılması” önerileri yer almıştır. Öğrenciler bu önerilere çoğunlukla katılmakla birlikte, dersi veren akademisyenlerin yeterliliğini, kendilerine girişimci özellikleri kazandırılmasına yönelik eğitimi, ilgi duyulan alanlara yoğunlaşma imkânının sağlanmasını, başarılı girişimcilerin derslere davetini ve uygulamalı projelere yönelik çalışmaların yapılmasını daha fazla önemsemişlerdir.

Tanrıverdi vd. (2016)'ne göre de eğitim alan girişimci adayların eğitime yönelik tutumlarının yüksek olduğu ve genel girişimcilik eğilimlerinin orta düzeyde; ancak eğilimin alt boyutu olan girişimciliğe yönelik heveslilik düzeyinin ise çok yüksek olduğu görülmüştür. Girişimcilik eğitime yönelik tutumun girişimcilik eğilimine etkisi olduğu fakat eğitimlerin eğilimleri açığa çıkarmada sadece heveslilik düzeyinde kaldığı görülmüştür. Eğitimin eğilimi açığa çıkarmada tek başına yeterli olmadığı

görülmektedir. Bu durum girişimcilik eğitimlerinin tekrar gözden geçirilmesine ve bazı düzenlemeler yapılmasının kaçınılmaz olduğunu göstermektedir.

Yapılan araştırma sonuçlarına göre de MYO'da girişimcilik dersi almak ile iş konusunda etkili kararlar almak arasında istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki bulunmamaktadır. MYO'da verilen girişimcilik derslerinin öğrencilerin iş konusunda etkili kararlar alması üzerinde herhangi bir etkisi yoktur.

Türkmen ve İşbilir (2014)'in belirttiği üzere girişimcilik kültürünün yaygınlaştırılması amacıyla ülke çapında girişimcilikle ilgili eğitimlerin, seminerlerin sayısının artırılarak girişimciliği insanlara aşılacak gerekmektedir. Eğitime yapılan yatırım artırılmalı, girişimci eğitim merkezlerine destek verilmelidir. Öğrenciler sporda girişimcilikle ilgili öğrenci kulüpleri kurarak, girişimcilik alanında çeşitli faaliyetlerde bulunmalıdırlar. Girişimcilik konusunda faaliyette bulunan kamu kurumları ve özel kuruluşlarla iletişim halinde olunmalıdır. Girişimcilerin karşılaştıkları bürokratik engeller azaltılmalı, finansal destek ve sermaye bulma konularında kolaylıklar sağlanmalıdır.

KAYNAKÇA

- Alpar, R. (2011) “Uygulamalı Çok Değişkenli İstatistiksel Yöntemler”, Detay Yayıncılık, Ankara.
- Balaban, Ö Ve Özdemir, Y. (2008) “Girişimcilik Eğitiminin Girişimcilik Eğilimi Üzerindeki Etkisi: Sakarya Üniversitesi İibf Örneği”, 3 (2): 133-147.
- Başboğa, Kadir (2008) “Girişimciliğin Desteklenmesi: Türkiye İçin Bölgesel Düzeyde Organizasyonel Yapılanma Önerisi”, Dpt Yayınlanmamış Uzmanlık Tezi, Ankara.
- Bilge, H. ve V. Bal (2012) “Girişimcilik Eğilimi: Celal Bayar Üniversitesi Öğrencileri Üzerine Bir Araştırma”, Süleyman Demirel Üniversitesi, Sbe Dergisi, 16: 131-148.
- Bozkurt Çetinkaya, Ö. ve Alparslan, A.M. (2013) “Girişimcilerde Bulunması Gereken Özellikler İle Girişimcilik Eğitimi: Girişimci Ve Öğrenci Görüşleri”, Girişimcilik Ve Kalkınma Dergisi 8(1):7-28.
- Büyükyılmaz, Ozan, Karakaya, Abdullah & Yıldırım, Canan (2016) “Girişimcilik Eğitimi Alan Bireylerin Demografik Özellikleri Açısından Girişimcilik Eğilimleri Arasındaki Farklar, Girişimcilik Ve Kalkınma Dergisi, 10(2): 105-205.
- Coulter, M. (2001) “Entrepreneurship In Action, Small Business 2000”, (New Jersey: Prentice- Hall).
- Çelik, A. Ve A., Tahir (2007) “Girişimcilik Kültürü Ve Kobi'ler”, Gazi Kitabevi, Ankara.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Çolakoğlu, Hale ve Çolakoğlu, Tanju (2016) “Üniversitelerdeki Girişimcilik Eğitimi İle Öz Yeterlilik Algısı Ve Girişimcilik Potansiyeli İlişkisi Üzerine Bir Saha Araştırması”, 17(37): 70–84. Girişimcilik Özel Sayısı,
- Doğaner, M. Ve Altunoğlu, A. E. (2010) “Adnan Menderes Üniversitesi Nazilli İktisadi Ve İdari Bilimler Fakültesi İşletme Bölümü Öğrencilerinin Girişimcilik Eğilimleri”, Organizasyon Ve Yönetim Bilimleri Dergisi 2(2): 103-110.
- Fidan, F. & Yeşil, Y. (2015) “Türkiye’de Kadın Girişimciliğini Geliştirmede Eğitim Faaliyetleri”, Akademik Sosyal Araştırmalar Dergisi. 3(14): 318-329.
- Güner, Hasan, (2010) “İstihdamın Arttırılmasında Girişimciliğin Önemi; Girişimciliği Destekleme Modeli Olarak İşgem’ler”, Süleyman Demirel Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Isparta.
- Güreşçi, E. (2014) “Girişimcilik Eğilimi Üzerine Bir Araştırma: İspir Hamza Polat Myo Örneği”, Girişimcilik Ve Kalkınma Dergisi 9(1): 23-38.
- Hırsrich, R.D, Peters, M. P ., and Shepherd, D.A (2008) “Enterpreneurship: Mc Graw Hill International Edition”.
- Kalaycı, Ş. (2014) “Spss Uygulamalı Çok Değişkenli İstatistik Teknikleri”, Asıl Yayın Dağıtım.
- Kılıç, R., Keklik, B. ve Çalış, N. (2012) “Üniversite Öğrencilerinin Girişimcilik Eğilimleri Üzerine Bir Araştırma: Bandırma İibf İşletme Bölümü Örneği”, Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi Ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi 17 (2): 423-435.
- Konakay, G. ve H. Demirkaya ve S. S. Altaş ve A. Y. Morkoyunlu & A. Özmen (2017) “Y Kuşağının Girişimcilik Eğilimlerinin Demografik Değişkenler İle İncelenmesi”, İjtebs, 1(1): 22-33.
- Korkmaz, O. (2012) “Üniversite Öğrencilerinin Girişimcilik Eğilimlerini Belirlemeye Yönelik Bir Araştırma: Bülent Ecevit Üniversitesi Örneği”, Afyon Kocatepe Üniversitesi, İibf Dergisi (C. Xıv, S İı, 2012):209-226.
- Kusmıntartı, A.,Anshori, M.A., Sulasari, A. & Ismanu, S.(2018). “Student's Entrepreneur Profile: A Cluster Of Student's Entrepreneurial Characteristics”, Journal Of Entrepreneurship Education, 21 (3): 1528-2651.
- Lounsbury, M. (1998). Collevtive Entrepreneurship; The Mobilization Of College And University Recyeling Coordinators, Journal Of Organizational Change Management, 11, (1): 51-60.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Meydan, M.C. (2013) "Girişimciliğin Ölçülmesi: Türkiye İçin Bölgesel Girişimcilik Endeksi Önerisi", Yüksek Lisans Tezi, T.C. Gazi Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İşletme Anabilim Dalı İşletme Bilim Dalı, Ankara.
- Mueller, S. & Thomas, A.S. (2000) "Culture And Entrepreneurial Potential: A Nine Country Study Of Locus Control And Innovativeness". Journal Of Business Venturing, 16: 52-62.
- Okursoy, A. & Turan, A. H. (2014), "Açımlayıcı Faktör Analizi Ve Üniversite Yemekhanesinde Müşteri Memnuniyeti Üzerinde Etkili Olan Boyutların Belirlenmesi Üzerine Bir Uygulama", Doğuş Üniversitesi Dergisi, 15(1): 65-78.
- Oosterberbeek, H., Praag Van, M., & Ijsselstein, A. (2010) The Impact Of Entrepreneurship Skills And Motivation" European Economic Review, 54(3): 442-454.
- Patır S. & Karahan, M. (2010). "Girişimcilik Eğitimi Ve Üniversite Öğrencilerinin Girişimcilik Profillerinin Belirlenmesine Yönelik Bir Alan Araştırması", İşletme Ve Ekonomi Araştırmaları Dergisi, 1(2): 27-44.
- Sarıtaş, Ahmet & Duran, Gülhan (2017) "Üniversite Öğrencilerinin Girişimcilik Eğilimlerinin Tespitine İlişkin Bir Araştırma", Muş Alparslan Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi Journal Of Social Sciences Of Muş Alparslan University, 5(1): 147-165.
- Solmaz, S. A., Aksoy, Ö., Şengül, S. & Sarıışık, M. (2014). "Üniversite Öğrencilerinin Girişimci Kişilik Özelliklerinin Belirlenmesi: Turizm Lisans Ve Ön Lisans Öğrencileri Üzerine Bir Alan Araştırması", Kümü Sosyal Ve EkonomiK Araştırmalar Dergisi, 16 (26): 41-55.
- Shane, S. & Venkataraman, S. Shane, S. (2000), "The Promise Of Entrepreneurship As A Field Of Research" Academy Of Management Review, 25(1): 217-226.
- Tanrıverdi, Haluk, Bayram Gül Nazik & Alkan, Makbule (2016). "Girişimcilik Eğitiminin Girişimcilik Eğilimi Üzerine Etkisinin İncelenmesi", Girişimcilik Ve Kalkınma Dergisi, 11(1): 1-29.
- Tekin, H. (2009), Eğitimde Ölçme Ve Değerlendirme. Yargı Yayınevi, 23. Baskı, Ankara.
- Türkiye Mesleki Ve Teknik Eğitim Strateji Belgesi Ve Eylem Planı (2014-2018), <https://Abdigm.Meb.Gov.Tr/Projeler/Ois/017.Pdf>, Erişim Tarihi:20.09.2018.
- Türkmen, Mustafa & İşbilir, Uğur (2014). "Üniversite Öğrencilerinin Girişimcilik Eğilimlerinin Sosyo Demografik Özellikler Açısından İncelenmesi", Cbü Bed. Eğt. Spor Bil. Dergisi / Cbu J Phys Edu Sport Sci, 9(2): 18-28.
- Ulusal İstihdam Stratejisi (2014-2023). [Http://Www.Uis.Gov.Tr/Media/1437/Uis2014-2023.Pdf](http://Www.Uis.Gov.Tr/Media/1437/Uis2014-2023.Pdf)

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Yarkın, D. & Yeşil, Y. (2016). "The Role Of Entrepreneurship Education On Internationalization Intention. A Case Study From Izmir-Turkey", *European Journal Of Social Sciences Education And Research*, Jan–Apr., 6 (1): 128-134.

Yılmaz, Ercan & Sünbül, Ali Murat (2009) "Üniversite Öğrencilerine Yönelik Girişimcilik Ölçeğinin Geliştirilmesi", *Selçuk Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 21: 195-203.



MAKROEKONOMİK GÖSTERGELERİN CDS PRİMİNİ AÇIKLAMA GÜCÜ: KIRILGAN BEŞLİ ÜLKELERİ İÇİN BİR PANEL ARDL ANALİZİ

Bünyamin EKREM*

* Pamukkale Üniversitesi, SBE İktisat ABD, Kınıklı Kampüsü, Denizli, Türkiye

ÖZET

2008 küresel finansal krizi, kapsadığı karmaşık ve yüksek hacimli türev ürünler nedeniyle diğer krizlerden farklı bir özellik taşımaktadır. Kredi temerrüt swapları (CDS), küresel krize damgasını vuran en önemli türev enstrümanlarından biri olmuştur. Dolayısıyla, CDS primleri ile makroekonomik değişkenler arasındaki ilişkilerin belirlenmesi finansal kriz literatürü açısından büyük önem taşımaktadır. Bu çalışmada ülke CDS primleri ile makroekonomik belirleyicileri arasındaki ilişkiler, “Kırılgan Beşli” olarak ifade edilen ülkeler (Türkiye, Brezilya, Endonezya, Güney Afrika ve Hindistan) için araştırılmaktadır. Veri eksikliği nedeniyle Hindistan hariç tutulmuş ve diğer ülkelerin CDS primleri ile büyüme, kamu borcu, cari denge, yabancı para cinsinden tahvil getirileri, faiz oranı ve reel kur arasındaki ilişkiler 2006Q4-2017Q4 dönemi için incelenmiştir. Büyüme oranındaki artışların, ülkenin iflas riskini düşüreceğinden, CDS primlerini negatif yönde etkilemesi beklenmektedir. Aynı şekilde, kamu borcu arttığında CDS primleri artacak, ülkeler cari fazla verdikçe de CDS primleri düşecektir. Faiz oranı olarak merkez bankalarının politika faizleri kullanıldığından faizlerdeki artış sıkılaşmaya işaret edeceği için CDS primini düşürecektir. Reel kur artışları ülkelerin rekabetçiliğini azalttığından CDS primlerini artırıcı etki yapması beklenmektedir. EMBI+ artışlarının ise CDS primini artıracığı öngörülmektedir. Bulgular, uzun dönemde değişkenlerin işaretlerinin beklentilere uygun olduğunu göstermektedir. Kısa dönemde ise değişkenlerin işaretleri beklentilerle uyumlu değildir. Yapılan çalışmalarda, CDS primlerinin sadece ülkelerin iflas riskini değil, CDS sözleşmelerinin likiditesini ve bazı global faktörlerin etkisini de yansıttığı vurgulanmaktadır. Bunun yanında, CDS primi hızlı hareket eden bir değişkendir ve çeyreklik frekans kullanılarak yapılan analizler sapmalı katsayılar elde edilmesine neden olabilir. Bu anlamda, modele yüksek frekansta yeni değişkenlerin eklenerek analizin tekrarlanması ayrı bir önem arz etmektedir.

Anahtar Kelimeler: Makroekonomik Göstergeler, CDS, Küresel Finansal Kriz, Kırılgan Beşli Ülkeleri, Panel ARDL

JEL Kodları: G01, E52, C53

** Pamukkale Üniversitesi, İİBF-İktisat Bölümü, Kınıklı Kampüsü, Denizli, Türkiye, icevis@pau.edu.tr Tel: (0258) 296 2728

*** Pamukkale Üniversitesi, İİBF-İktisat Bölümü, Kınıklı Kampüsü, Denizli, Türkiye

**** Pamukkale Üniversitesi, İİBF-İktisat Bölümü, Kınıklı Kampüsü, Denizli, Türkiye

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

**THE EXPLANATORY POWER OF MACROECONOMIC INDICATORS ON CDS
PREMIUM: A PANEL ARDL ANALYSIS FOR FRAGILE FIVE COUNTRIES**

ABSTRACT

The 2008 global financial crisis is different from other crises due to the complex and high volume of derivative products it covers. Credit default swap (CDS) has been one of the most important derivative instruments of the global crisis. Therefore, determining the relations between CDS premium and macroeconomic variables is of great importance in terms of financial crisis literature. In this study, the relationship between sovereign CDS premium and macroeconomic determinants is being investigated for "Fragile Five" countries (Turkey, Brazil, Indonesia, South Africa and India). Due to lack of data, India was excluded and the relations between CDS premium of other countries and growth, public debt, current balance, foreign currency bond yields, interest rate and real exchange rate were examined for the period of 2006Q4-2017Q4. It is expected that increase in the growth rate will adversely affect CDS premiums as the country will reduce the risk of bankruptcy. Likewise, when public debt increases, CDS premium will increase and it will decrease as countries give current surplus. Since interest rates are used as the policy rates of central banks, an increase in interest rates will reduce the CDS premium due to tightened policies. Because of increases in real exchange rates will decrease the competitiveness of the countries, it is expected to increase CDS premiums. EMBI+ increases are also expected to increase CDS premium. Findings show that the signs of the coefficients are consistent with the long-term expectations. But in the short term, the signs of coefficients do not cover the expectations. In literature, it is emphasized that CDS premium does not only reflect default risk of the countries but also the effects of liquidity of CDS contracts and some other global factors. However CDS premium is a fast-moving variable and using quarterly series in analyses may lead biased coefficients. In this sense, it is significant that adding new variables with high frequency to the model and reanalysing.

Keywords: *Macroeconomic Indicators, CDS, Global Financial Crisis, Fragile Five Countries, Panel ARDL*

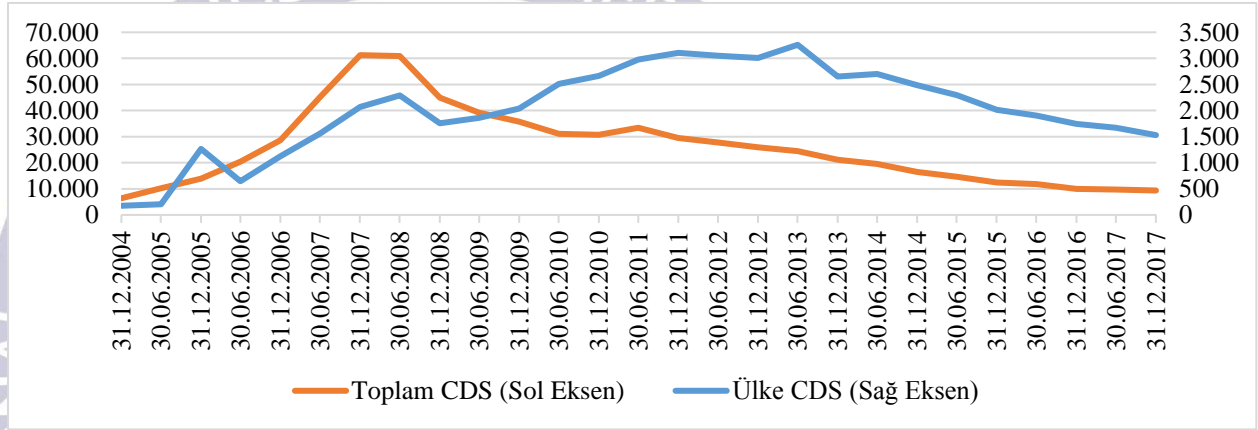
JEL Codes: *G01, E52, C53*

1.GİRİŞ

Kredi Temerrüt Takası (CDS, Credit Default Swap), 1990'lı yılların başlarında artan kredi riskini bölme ve dağıtma talebini karşılamak üzere JP Morgan tarafından tasarlanmış olup, en basit kredi türevi

enstrümanı sınıfını oluşturmaktadır (Augustin, 2014). CDS, prim (fiyat, spread) olarak adlandırılan belirli bir ödeme tutarı karşılığında muhtemel bir kredi olayı yaşanması durumunda koruma sağlayan sabit getirili bir türev enstrümandır. International Swaps and Derivatives Association (ISDA), bir ülke CDS'inde kredi olayını; yükümlülüğün muaccel hale gelmesi, ödeyememe, yeniden yapılandırma ve orcu reddetme olarak tanımlamaktadır (Dieckman ve Plank, 2011). Bir CDS işleminde kredi riskine sahip olan taraf ödediği prim karşılığında CDS satıcısından koruma satın alır. CDS sözleşmesi süresi içerisinde bir kredi olayı yaşanması durumunda, CDS satıcısı alıcı tarafa sözleşmede yer alan tutarı öder.

Grafik 1. CDS Sözleşmesi Tutarı (Milyar ABD \$)



Kaynak: BIS

CDS sözleşmeleri, büyük ölçekli finansal kuruluşlar arasında tezgah üstü (OTC) piyasalarda işlem görür (Arora, Gandhi ve Longstaff, 2012). Grafik 1'den de görüldüğü gibi, 2000'li yılların başından itibaren CDS piyasası hızlı bir şekilde büyümüş, ve BIS verilerine göre 2007 yılında 60 trilyon ABD Doları'na çıkarak zirve noktasını görmüştür. 2008 krizinden sonra ise düşmeye başlamış ve 2017 yılı sonu itibariyle 9 trilyon ABD Doları'na kadar gerilemiştir. Bu düşüşte, türev ürünlerinin 2008 Krizi'nin merkezinde olması, otoritelerin yükümlülüklerin yerine getirilememesi riskine ilişkin artan kaygıları nedeniyle alacak pozisyonlarının netleştirilmesi ve daha fazla şeffaflık talep etmeleri sonucu portföylerin daraltılması etkili olmuştur (Augustin, 2014). Aynı dönemde ülke CDS'leri ise, 2013 yılında 3 trilyon ABD Doları'nın üzerine çıkmış, 2017 itibariyle ise 1,5 trilyon ABD Doları'na düşmüştür.

2008 finansal krizini diğer krizlerden ayıran en önemli özellik, bu krizin karmaşık ve yüksek hacimli türev ürünleri kapsamıdır (Işık ve Tünen, 2008). 2007 yılında ABD'de subprime mortgage piyasasından doğan ve daha sonra tüm dünyaya yayılan, birçok ülkede ekonomik daralmalara yol açan global finansal krizin kökeninde eksik hesaplanan kredi riski ve yeni türev enstrümanlar nedeniyle

yükselen kaldıraç oranları vardır. En önemli kredi türevi tipi CDS'lerdir ve son yirmi yılda geliştirilen en tartışmalı türev enstrüman olmuşlardır (Shahzad, Nor, Ferrer ve Hammoudeh, 2016).

Dolayısıyla, CDS primleri makroekonomik değişkenler arasındaki ilişkilerin belirlenmesi finansal literatürü açısından büyük önem arz etmektedir. Bu çalışmada, Kırılgan Beşli ülkeleri için (Hindistan¹⁵ hariç Türkiye, Brezilya, Endonezya ve Güney Afrika) 2006Q4-2017Q4 dönemlerinde CDS primleri ile ülkelerin büyüme, kamu borcu, cari denge, yabancı para cinsi tahvil getirileri, faiz oranı ve reel kur arasındaki ilişki incelenmektedir.

2.KIRILGAN BEŞLİ ÜLKELERİ

Kırılgan beşli ifadesi ilk olarak Morgan Stanley Research tarafından 5 Ağustos 2013 tarihinde yayınlanan raporda kullanılmış olup, bu raporda Türkiye, Brezilya, Endonezya, Güney Afrika ve Hindistan para birimleri kırılgan beşli olarak ifade edilmiştir. Söz konusu raporda, FED'in sıkılaşmaya başlayacağı riskiyle beraber gelişmekte olan piyasa para birimlerinin ABD Dolarına karşı yaşadıkları değer kaybı vurgulanmış olup, uzun dönemde bu değer kaybına cari açık pozisyonlarındaki bozulma neden olarak gösterilmiştir. Cari açığındaki bozulmaya neden olarak ise, gelişmiş ülkelerin zayıf büyüme performansı, düşen hammadde fiyatları, yavaşlayan Çin ekonomisi, yüksek enflasyon ve artan reel döviz kuruyla ilintili olarak dış rekabet gücündeki bozulma öne sürülmüştür. Böylece döviz rezervlerindeki büyümenin negatife dönerek uzun dönemde döviz rezervlerinin düştüğü ifade edilmiştir.

Tüm bunların yanı sıra, FED'in para politikasını normalleştirme beklentisi riskleri artırmaktadır. Zaten düşük ihracat performansı ve sermaye akımları nedeniyle döviz çekmekte zorlanan gelişmekte olan ülkeler, artan ABD Hazine tahvili getirileriyle beraber sermayenin ABD'ye geri dönmesi riskiyle karşı karşıyadır. Raporda, orta vadede gelişmekte olan ülkelerin görünümünü etkileyen faktörler olarak; enflasyon, reel döviz kuru, endüstriyel metal fiyatları, sabit getirili enstrümanlara olan sermaye akımı, cari açık pozisyonu ve hesaplanan dış kırılganlıklar endeksi sayılmıştır. Bu sayılan faktörlerden Kırılgan Beşli olarak tanımlanan ülkelerin ise orta vadede enflasyon, yüksek reel döviz kuru, mevcut dış kırılganlıklar ile yüksek dış sermaye bağımlılığı ve/veya Çin'e ilişkin riskler nedeniyle daha da derinleşecek dışsal bozulmalar ile karşılaşacağı belirtilmiştir.

Grafik 2'de ele alınan dönem için analizde yer alan ülkelerin bazı makroekonomik göstergeleri yer almaktadır. 2008 Krizi'yle beraber tüm ülkelerin büyüme performanslarının düştüğü görülürken, Endonezya harici diğer ülkelerin negatif büyüme oranlarına sahip olduğu görülmektedir. 2009 yılı 4. çeyreğinden sonra tüm ülkelerin tekrar pozitif büyümeye geçtikleri görülmektedir. İncelenen dönemde

¹⁵ Veri kısıtından dolayı analiz dışı tutulmuştur.

Endonezya'nın %5 civarında istikrarlı bir büyüme oranına sahip olduğu görülürken, diğer ülkelerin daha dalgalı büyüme oranları yakalamış oldukları gözlemlenmektedir. Dikkat çeken bir diğer nokta ise Brezilya'nın 2014 yılında küçülmeye başladığı ve ancak 2017 yılında tekrar büyümeye başladığıdır.

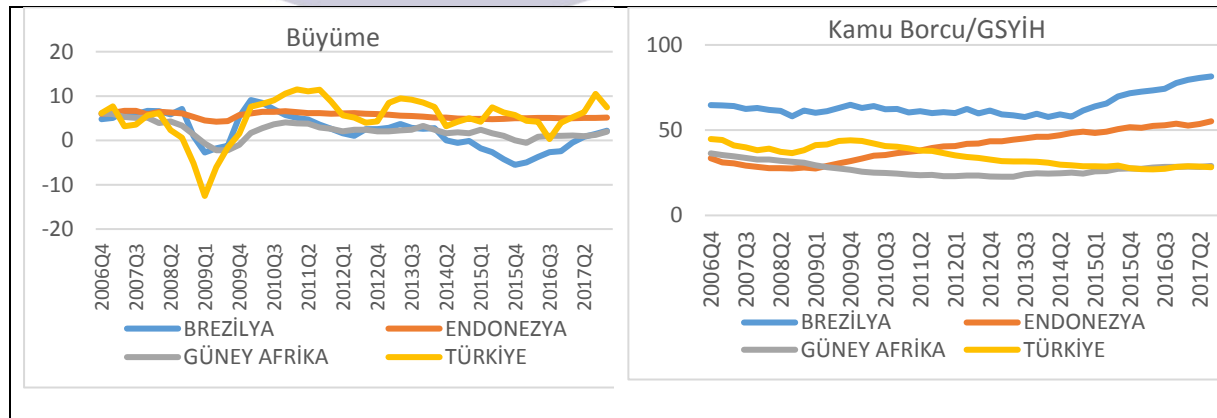
İncelenen ülkeler içerisinde en yüksek kamu borcu/GSYİH oranına sahip ülkenin Brezilya olduğu görülmektedir. Türkiye'nin borcunun 2008 krizinden sonra bir miktar yükseldikten sonra tekrar düşüşe geçtiği görülmektedir. Endonezya'nın 2008 Krizi'nden sonra istikrarlı bir şekilde kamu borcu oranı artmakta, Brezilya'nın ise 2014 yılından itibaren hızlı bir şekilde artmaktadır.

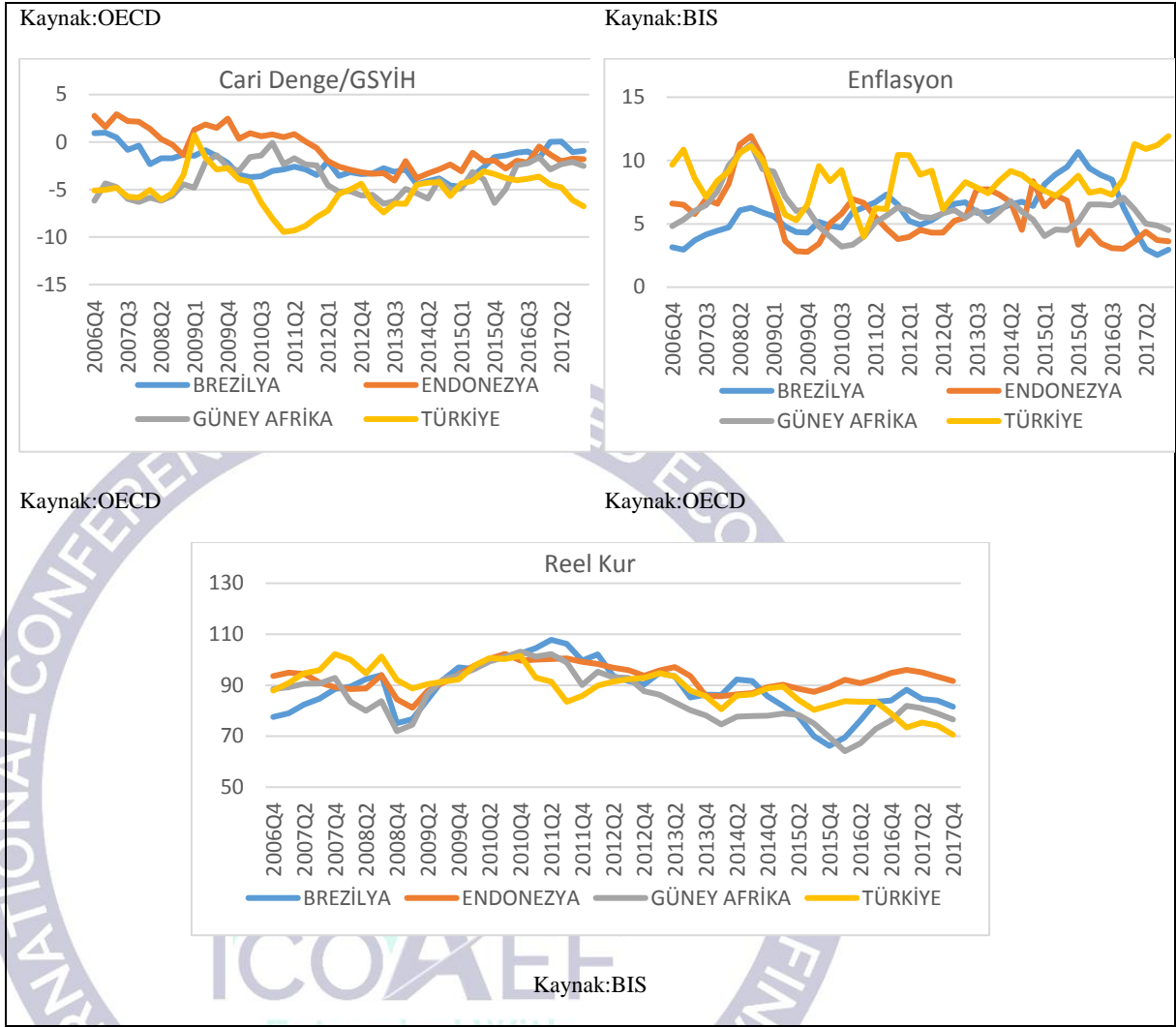
İncelenen dönem içerisinde ülkeler genelde cari açık vermektedirler. 2008 Krizi'nde ülkelerin cari açıklarında bir iyileşme olsa da, daha sonra bu performansın korunamadığı görülmektedir. Türkiye 2010-2011 yıllarında %10'a yaklaşan cari açıklar vermişken daha sonra cari açık oranında küçülmeler görülmektedir. Ancak 2017 yılında tekrar cari açıkta bozulma görülmeye başlanmıştır.

2008 Krizi'nin etkisiyle tüm ülkelerin tüketici enflasyonlarında artış yaşanmış, Türkiye, Güney Afrika ve Endonezya'da çift haneli rakamlar görülmüştür. Son dönemde ülkeler enflasyon oranlarını düşürmeyi başarmış olsa da aynı şey Türkiye için söylenememektedir. Türkiye'de tüketici fiyatları 2016 yılı 3. çeyreğinden sonra yükselişe geçmiş, 2017 boyunca çift haneli rakamlarda seyretmiş ve yıl sonunu %11,92 ile kapatmıştır. Diğer ülkelerde bu oranın %5'in altında olduğu görülmektedir.

Grafik 2'de ayrıca tüketici fiyat endeksini temel alan ve ülkelerin dış ticaret yaptıkları ülkelere göre ağırlıklandırılarak hesaplanmış reel efektif döviz kuru endeksi yer almaktadır. (2010 baz yılı=100) olarak seçilmiş ve yükselişler reel kurun değerlenmesini ifade etmektedir. İncelenen dönem içerisinde ülkelerin reel efektif döviz kurlarının dalgalı bir seyir izlediği görülmektedir. Genel olarak 2010 yılında zirvesini gördükten sonra reel kurlar düşüş göstermiştir. Endonezya'nın diğer ülkelere göre daha istikrarlı bir reel kura sahip olduğu dikkat çekmektedir.

Grafik 2. Ülkelerin Makro Göstergeleri





ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Tang ve Yan (2006), seçili ABD şirketleri üzerinde yapılan çalışmada hem CDS piyasasındaki hem de diğer bono, hisse senedi ve opsiyon piyasalarındaki likiditenin yayılma etkisinin CDS primleri üzerinde anlamlı etkileri olduğu sonucuna varmıştır.

In, Kang ve Kim (2007), Brezilya, Kolombiya, Meksika, Filipinler, Rusya, Türkiye, Venezuela ülkelerini kapsayan çalışmalarında, CDS primleri ile kredi spreadi arasında uzun dönemli denge ilişkisinin bulunduğunu tespit etmişlerdir.

Ammer ve Cai (2011) ise Brezilya, Çin, Kolombiya, Meksika, Filipinler, Rusya, Türkiye, Uruguay, Venezuela'yı inceledikleri çalışmalarında söz konusu 9 ülkeden 7'sinde CDS primleri ile kredi spreadleri arasında eşbütünleşme olduğu sonucuna ulaşmışlardır.

Longstaff, Pan, Pedersen ve Singleton (2011), Brezilya, Bulgaristan, Şili, Çin, Kolombiya, Hırvatistan, Macaristan, İsrail, Japonya, Kore, Malezya, Meksika, Pakistan, Panama, Peru, Filipinler, Polonya, Katar, Romanya, Rusya, Slovakya, Güney Afrika, Tayland, Türkiye, Ukrayna, Venezuela ülkelerinin CDS primlerinin ele alındığı çalışmada, incelenen değişkenleri içerisinde CDS primi üzerinde en önemli etkiye sahip olanların ABD hisse senedi piyasası getirisi, High Yield Index ve volatilité olduğu sonucuna varmışlardır.

Dieckman ve Plank (2011), Ocak 2007-Nisan 2010 dönemleri içerisinde panel veri ve zaman serisi analizi yaptıkları, Belçika, Çekya, Danimarka, Finlandiya, Fransa, Almanya, Yunanistan, Macaristan, İrlanda, İtalya, Hollanda, Polonya, Portekiz, Slovenya, İspanya, İsveç, Birleşik Krallık ülkelerini kapsayan çalışmalarında, CDS primi üzerinde ülkelerin finansal sistemlerinin durumunun yanı sıra, krizin başlangıcından itibaren global finansal sistemin durumu da güçlü bir şekilde etkili olduğu ve bu etkinin büyüklüğünün ülkelerin kriz öncesi finansal durumuna bağlı olduğunu tespit etmişlerdir.

Çiftçi ve Çeviş (2012), sabit etki modeli kullanılarak 2004Q1-2011Q2 dönemleri içerisinde 14 AB ülkesi üzerine yaptıkları analizde, ülkelerin kamu borcunun GSYİH'e oranı 1 birim arttığında CDS priminin 11,9 birim, ülkelerin reel faiz oranı, reel kur seviyesi, rezervleri ile kamu borçlarının kullanılarak elde edildiği bir kriz endeksinin 1 birim arttığında ise CDS priminin 5,6 birim arttığı sonucuna varılmıştır.

Eyssell, Fung ve Zhang (2012), Ocak 2001- Aralık 2010 dönemleri arasında Çin üzerine yaptıkları zaman serisi analizinde, CDS'ler üzerinde hem global hem de yerel faktörler etkili olduğu ancak, krizden sonra global faktörlerin etkisinin arttığı sonucuna varmışlardır.

Shahzad, Nor, Ferrer ve Hammoudeh (2016) tarafından NARDL yöntemi kullanılarak 10 adet ABD endüstri CDS'lerinin incelendiği çalışmada, hisse senedi endeksi, VIX ve ABD 5 yıllık hazine

tahvili getirisi ile daha düşük bir oranda olmak üzere ham petrol fiyatının, endüstri CDS endekslerinin önemli asimetric belirleyicileri olduğu sonucuna varmışlardır.

4.AMPİRİK MODEL VE VERİ SETİ

Çalışmamızda 2006:Q4 ile 2017:Q4 arasını kapsayan dönemde Türkiye, Brezilya, Endonezya ve Güney Afrika ülkelerinin CDS primlerinin belirleyicileri ülkelere özgü parametreler yardımıyla incelenecektir.

Tablo 1. Değişkenler

| Değişken | Tanım | Kaynak |
|------------|--|-----------|
| CDS | Kredi temerrüt swapı primi (baz puan) | Bloomberg |
| Büyüme | Sabit fiyatlarla GSYİH'nin bir önceki aynı yılın aynı dönemine göre değişimi (%) | OECD |
| Kamu Borcu | Brüt merkezi hükümet borcunun GSYİH'e oranı (%) | BIS |
| Cari Denge | Ödemeler dengesinin cari işlemler hesabının GSYİH'e oranı (%) | OECD |
| EMBI+ | JP Morgan tarafından oluşturulan ve bazı gelişmekte olan ülkelerin yabancı para cinsi bono ve tahvillerinin getirilerinin ABD Hazine tahvili getirisinden farkı (baz puan) | Bloomberg |
| Faiz Oranı | Merkez bankası politika faiz oranı (%) (Türkiye için 2011 yılından itibaren ağırlıklı ortalama fonlama faizi alındı) | BIS, TCMB |
| Reel Kur | Ülkelerin dış ticaret yaptıkları ülkelere göre ağırlıklandırılarak tüketici enflasyonlarına göre tekrar hesaplanan döviz kuru endeksi (2010=100) | BIS |

$$\log(CDS) = a_0 + a_1 \text{Büyüme Oranı} + a_2 \text{Kamu Borcu} + a_3 \text{Cari Denge} + a_4 \log(EM) + a_5 \text{Faiz Oranı} + a_6 \log(\text{Reel Kur}) \quad (1)$$

denklemini ampirik modeli oluşturmaktadır.

Büyüme oranı arttıkça ülkenin iflas riski düşeceğinden hareketle a_1 katsayısının pozitif olması beklenmektedir. Benzer bir yaklaşımla, kamu borcu arttığında CDS primleri artacak, ülkeler cari fazla verdikçe ise CDS primleri düşecektir, EMBI+ arttıkça CDS primi de artacaktır. Faiz oranı olarak aldığımız değişken merkez bankaları politika faizleri olduğundan, bu faizlerdeki bir artış sıkılaşmaya işaret edeceğinden CDS primini düşürecektir. Reel kur arttığında, ülkelerin rekabetçiliği azalacağından CDS primleri de yükselecektir.

4.1.Ampirik Metodoloji

Aynı anda düzeyde veya farkta durağan olan serilerle çalışma imkanı vermesi nedeniyle, yöntem olarak kullanılacak olan panel ARDL(p,q) modelinin genel formu;

$$Y_{it} = \sum_{j=1}^p \lambda_{ij} Y_{i,t-j} + \sum_{j=0}^q \gamma_{ij} X_{i,t-j} + \mu_i + e_{it} \quad (2)$$

şeklinde yazılabilir. Y_{it} bağımlı değişken vektörü, X_{it} bağımsız değişkenlerin $K \times 1$ boyutunda vektörü, λ_{ij} ve γ_{ij} skaler ve μ_i bireysel grup etkilerini ifade etmektedir.

Trend, mevsimsellik, politik veya ekonomik faktörler nedeniyle seriler durağan olmayabilir. Bu durumda sahte regresyon problemi doğabilir. Bu nedenle durağan olamayan serilerin uzun dönemle ilişkili olup olmadığını incelemek için eşbütünleşme analizi kullanılır. Eşbütünleşik değişkenler uzun dönem dengelerinden sapma gösterebilir. Uzun dönem katsayılar β -ların homojen olduğu Pesaran vd. (1999) tarafından geliştirilen PMG (Pooled Mean Group) modeli, tekrar parametrize edilerek bu sapmalardan kaynaklanan hata düzeltme modeli aşağıdaki gibi yazılabilir:

$$\Delta Y_{it} = \theta_i (Y_{i,t-1} - \beta' X_{i,t-1}) + \sum_{j=1}^{p-1} \lambda_{ij} \Delta Y_{i,t-j} + \sum_{j=1}^{q-1} \gamma'_{ij} \Delta X_{i,t-j} + \mu_i + e_{it} \quad (3)$$

Bu eşitlikte λ_{ij} ve γ_{ij} kısa dönem katsayılar β uzun dönem katsayılar, θ_i hata düzeltme terimi olup işareti negatif ve istatistiksel olarak anlamlı olmalı. Hata düzeltme terimi, uzun dönem dengeden sapmaya neden olan bağımsız değişkenlerdeki şokların etkisinin yüzde kaçının bir dönem içerisinde ortadan kalktığını ifade eder.

Katsayıların homojen/heterojen olmasına Hausman tipi testlerle karar verilir. Eğer katsayılar homojense PMG tahmincisi, katsayıların heterojen olmasına izin veren MG (Mean Group) tahmincisinden daha etkindir. Başka bir deyişle, uzun dönem katsayıların homojen olduğu boş hipotez altında PMG seçilir. Aksi durumda MG tahmincisi tercih edilir.

4.2. Birim Kök ve Panel ARDL Test Sonuçları

Çalışmada I. nesil ve yatay kesit bağımlılığını da dikkate alan II. nesil birim kök testlerinden uygulanmıştır. Im, Pesaran and Shin (IPS), ADF Fisher Chi-square (ADF Fisher) ve Pesaran CADF testleri uygulanmıştır:

Tablo 2. Birim Kök Testi Sonuçları

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| Değişken | Im-Pesaran-Shin W-İstatistiği | ADF - Fisher Chi-square | Pesaran CADF t-İstatistiği |
|--------------------|----------------------------------|----------------------------|-------------------------------|
| Log(CDS) | -3.35095*** | 25.9915*** | -2.348 |
| Büyüme Oranı | -1.61755* | 13.8869* | -2.064 |
| Cari Denge/GSYİH | -1.57905* | 12.4264 | -2.291 |
| Kamu Borcu/GSYİH | 1.36516 | 6.47659 | -1.713 |
| Faiz Oranı | -1.39939* | 12.1864 | -2.135 |
| Log(EMBI+) | -3.57268*** | 28.1987 | -1.704 |
| Log(RER) | -1.09853 | 10.8241 | -2.989* |
| Δ Log(CDS) | --6.84816*** | 59.1611*** | -3.371*** |
| Δ Büyüme Oranı | -3.68346*** | 28.7833*** | -3.197** |
| Δ Cari Denge/GSYİH | -3.68021*** | 28.5001*** | --2.727** |
| Δ Kamu Borcu/GSYİH | -3.16328*** | 24.4993*** | -2.681 |
| Δ Faiz Oranı | -2.59092*** | 19.1177** | -2.077 |
| Δ Log(EMBI+) | -7.07416*** | 61.4326*** | -2.644** |
| Δ Log(RER) | -6.03401*** | 47.1193*** | -3.464** |

***, ** ve * sırasıyla %1, %5 ve %10 güven aralığını temsil etmektedir.

Birim kök testleri incelendiğinde, IPS ve ADF Fisher testlerine göre tüm değişkenlerin farkının durağanlaştığı gözlemlenirken, Pesaran CADF testine göre kamu borcu ve faiz değişkenlerinin birinci farklarının durağanlaşmadığı gözlemlenmektedir. Ancak söz konusu diğer iki teste göre de durağanlaştıklarından Pesaran CADF testinin sonuçları göz ardı edilmiştir.

Tablo 3. Panel ARDL Test Sonuçları

| | PMG | MG | Hausman |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|
| <i>Uzun Dönem</i> | | | |
| Büyüme Oranı | -0.0271939*** (0.0014004) | -0.0263302*** (0.0091983) | chi2(6)=5.60 Prob=0.4689 |
| Kamu Borcu/GSYİH | 0.0050667*** (0.0006666) | 0.0093767** (0.0043886) | |
| Cari Denge/GSYİH | -0.0021659 (0.0031038) | 0.0065959 (0.015911) | |
| Log(EMBI+) | 0.8273463*** (0.0461131) | 1.364938*** (0.248641) | |
| Faiz Oranı | -0.0074367*** (0.0018041) | 0.0071104 (0.0248782) | |
| Log(Reel Kur) | 0.2202699*** (.0561179) | 0.5748376 (1.073283) | |
| <i>Kısa Dönem</i> | | | |
| ECT | -0.7688947* (0.4297979) | -0.6995669 (0.4976504) | |

| | | |
|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| Δ Büyüme Oranı | 0.0335234* (0.0192872) | 0.0356502 (0.0222233) |
| Δ Büyüme Oranı(-1) | 0.0121521* (0.0067227) | 0.0189462** (0.0079929) |
| Δ Cari Denge/GSYİH(-1) | 0.0124443** (0.0051402) | 0.0124074*** (0.0039728) |
| Δ Log(Reel Kur) | -0.436372*** (0.1608363) | -0.740309* (0.4170562) |
| Sabit | -0.6530968* (0.389489) | -3.597918 (2.21449) |

***, ** ve * sırasıyla %1, %5 ve %10 güven aralığını temsil etmektedir.
Parantez içindeki değerler standart hataları göstermektedir.

Tablo 3'te uygulanan panel ARDL yöntemi ile elde edilen sonuçlar ve uzun dönem katsayıların homojen/heterojen alınmasına karar verilen Hausman test sonuçları verilmektedir. Optimal gecikme sayısı Akaike bilgi kriterine göre seçilmiş olup uygun modelin ARDL(4,3,3,3,3,3) olduğu görülmüştür. Tablodan kısa dönemde anlamlı istatistiksel sonuçlar bulunamayan değişkenler çıkarılmıştır. Hausman testi sonucunda katsayıların homojen olduğu görülmüş ve PMG tahmincisinin kullanılmasına karar verilmiştir.

Uzun dönem katsayılar cari denge haricinde istatistiksel olarak anlamlı bulunmuştur. İncelenen ülkeler %1 büyüdüğünde CDS primleri %2,7 azalmaktadır. Kamu borcunun GSYİH'e oranı %1 arttığında ise CDS primi %0,5 yükselmektedir. EMBI+ endeksi %1 artış gösterdiğinde CDS primleri %0,8 artış göstermektedir. Merkez bankaları politika faizleri %1 sıkılaştığında CDS primleri %0,7 düşmektedir. Reel efektif kur ise %1 arttığında CDS primleri %0,2 artmaktadır. Tüm bulunan katsayıların işaretleri teorik beklentiler yönünde olmakla beraber, yalnızca cari açığın CDS primi üzerinde araştırılan model çerçevesinde istatistiksel olarak anlamlı bir etkiye sahip olmadığı görülmüştür. Göreli etkiler incelendiğinde, CDS primi üzerinde en büyük etkiye büyüme oranının sahip olduğu görülürken en küçük etkiye ise reel kurun sahip olduğu görülmüştür.

Hata düzeltme terimi (ECT) anlamlı bulunmuş olup bu sonuca göre açıklayıcı değişkenlerde meydana gelen şokların etkisinin %76'sının bir çeyrek içinde ortadan kalktığı sonucuna varılmıştır.

Kısa dönem katsayılar incelendiğinde sadece büyüme oranının farkı ve birinci gecikmesi, cari dengenin farkının birinci gecikmesi ile reel kurun farkı istatistiksel olarak anlamlı değişkenlerdir. Burada dikkat edilirse katsayıların işaretlerinin uzun döneme göre zıt işaretli olduğu, ayrıca uzun dönemde anlamlı olmayan cari dengenin kısa dönemde anlamlı olduğu görülmektedir. Değişkenlerin CDS primi üzerinde göreceli etkileri incelendiğinde ise en büyük etkiye sahip değişkenin büyüme oranı olduğu görülmektedir.

Uzun dönemde cari dengenin CDS üzerinde anlamlı bir etkisinin bulunamaması oldukça şaşırtıcıdır. Bilinmektedir ki, cari işlemler hesabı, söz konusu ülkeler için çok önemli bir kırılma faktörü olarak öne sürülmektedir. Ancak literatürdeki diğer çalışmalar incelendiğinde, CDS primini etkileyen değişkenler olarak hisse senedi piyasası oynaklığı, CDS kontratlarının likiditesine ilişkin değişkenler, CDS primine referans olacak düşük riskli ülke (ABD, Almanya vs.) tahvil getirileri, döviz kuru ve hisse senedi piyasası endeksleri gibi parametreler de analiz edilmiştir. Dolayısıyla, bahsedilen değişkenlerin de ilave edilerek gerçekleştirilecek analizlerde cari işlemler dengesi ile ilgili anlamlı sonuçlar elde edilebileceği düşünülmektedir.

Hata düzeltme katsayısının büyüklüğü ve kısa dönemde anlamlı yüksek gecikme sayısına sahip değişkenler bulunamaması, CDS gibi hızlı hareket eden finansal değişkenlerin yüksek frekanslı veri setiyle analiz edilmesinin daha uygun olabileceğini göstermektedir. Ayrıca, hızlı hareket eden finansal serileri düşük frekanslı değişkenlerle açıklamak, sapmalı katsayılar elde edilmesine neden olabilmektedir.

Kısa dönemde, büyüme oranındaki yükselmenin CDS primini de yükselttiği sonucuna varılması, incelenen ülkelerin büyüme dinamikleri ve potansiyelin üzerinde büyüme performanslarından kaynaklanmış olabileceği değerlendirilmektedir. Tüketim ve kamu harcamalarına dayalı potansiyelin üzerindeki büyüme rakamlarının incelenen ülkelere ilişkin kırılma noktaları artıracağı açıktır.

Kısa dönemde cari denge katsayısı negatif işaretli olması beklenirken pozitif bulunması beklentilerle çelişmektedir. İncelenen dönemde ülkeler genellikle cari işlemler hesabında açık vermiştir. Ayrıca söz konusu dönemin büyük bölümünde 2008 Krizi'nin yaralarını sarmaya çalışan gelişmiş ülke merkez bankaları tarafından daha önce görülmemiş düzeyde genişletici para politikaları uygulanmıştır. Dolayısıyla, küresel likidite bolluğu içerisinde çalışmamıza konu olan ülkelerde cari açık finansmanı ile ilgili endişeler hafiflemiştir. Bu anlamda, cari denge değişkeninin beklentilerle uyumsuz işarete sahip olduğu değerlendirilmektedir.

Kısa dönemde reel kur artışının CDS primini düşürücü etkiye sahip olduğu sonucuna varılması, nominal döviz kurunun etkisinden kaynaklandığı düşünülmektedir. Bilindiği üzere yerli paranın değer kazanarak döviz kurunun düşmesi reel efektif döviz kurunu yükseltici etki yapacaktır. Kısa dönemde güçlenen yerel para, söz konusu ülkelerde dış borçların ödenebilirliğine ilişkin endişeleri azaltacak, enflasyon üzerinde azaltıcı etkileri olacaktır. Böylelikle söz konusu ülkelerin riskleri üzerinde aşağı yönlü baskı oluşacaktır.

5.SONUÇ

Bu çalışmada, gelişme aşamasında olan CDS literatüründeki çalışmalara farklı bir bakış açısı getirilerek, ülke CDS primlerinin makro değişkenler üzerinden açıklandığı bir panel ARDL analizi yapılmıştır. Uzun dönemde değişkenlerin işaretleri beklenti yönünde çıkmış ve istatistiksel olarak anlamlı çıkmıştır. Buna göre analizde yer alan makroekonomik değişkenler CDS primini açıklar niteliktedir. Ancak kısa dönem katsayılarında açıklanmayı bekleyen önemli zıtlıklar görülmüştür. Bu anlamda, modele yüksek frekanslı ve literatürdeki çalışmalara paralel değişkenler eklenerek yeniden analizler yapılmasının önemli olduğu düşünülmektedir. Ayrıca, merkez bankalarının genişletici politikalar uyguladığı periyotlar ile normalleşme ve daraltıcı politikalara başladığı periyotları, ülkelerin büyüme karakteristiklerini de dikkate alan daha detaylı analizlerin faydalı olacağı değerlendirilmektedir.

KAYNAKÇA

- Ammer, J. ve Cai, F. (2011) "Sovereign CDS and Bond Pricing Dynamics in Emerging Markets: Does the Cheapest-To-Deliver Option Matter?", *Journal of International Financial Markets, Institutions and Money*, 21 (3): 369-387
- Arora, N., Gandhi, P. ve Longstaff, F.A. (2012) "Counterparty Credit Risk and the Credit Default Swap Market", *Journal of Financial Economics* 103 (2): 280-293
- Augustin, P. (2014) "Sovereign Credit Default Swap Premia", NYU Working Paper
- Badaoui, S., Cathcart, L. Ve El-Jahel, L. (2013) "Do Sovereign Credit Default Swaps Represent a Clean Measure of Sovereign Default Risk? A Factor Model Approach", *Journal of Banking & Finance* 37, (7): 2392-2407
- Blanco, R., Brennan, S. ve Marsh, I.W., (2006) "An Empirical Analysis of the Dynamic Relation between Investment-Grade Bonds and Credit Default Swaps", *The Journal of Finance* Vol. LX, (5): 2255-2281.
- Çiftçi, D. ve Çeviş, İ. (2012) "Küresel Finansal Kriz Işığında Avrupa Borç Krizi ve Kredi Temerrüt Swapları İlişkisi", *İktisat İşletme ve Finans* 27 (321): 2012:57-84
- Dieckman, S. ve Plank, T. (2011) "Default Risk of Advanced Economies: An Empirical Analysis of Credit Default Swaps during the Financial Crisis", *Review of Finance* (2012) 16: 903-934.
- In, F., Byoung Uk Kang, B.U. ve Tong, S.K. (2007) "Sovereign Credit Default Swaps, Sovereign Debt and Volatility Transmission across Emerging Markets", *SSRN Electronic Journal*. 10.2139/ssrn.1090408.
- Işık, N. ve Tünen, T. (2011) "Türev Ürünlerin 2008 Küresel Finansal Krizindeki Rolü", *Avrasya Etüdüleri* 39/2011-1 (7-48).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Longstaff, F.A. (2011) "How Sovereign Is Sovereign Credit Risk?", American Economic Journal:Macroeconomics, 3 (2): 75-103.

Tang, D.Y. ve Yan, H. (2006) "Liquidity, Liquidity Spillover, and Credit Default Swap Spreads", https://www.researchgate.net/publication/241524363_Liquidity_Liquidity_Spillover_and_Credit_Default_Swap_Spreads, (14/12/2018).



RELATIONSHIP BETWEEN FINANCIAL LITERACY AND FINANCIAL SELF-EFFICACY: A RESEARCH ON UNIVERSITY STUDENTS

Dilek DEMİRHAN*

Özgür BABACAN**

Ahmet Rutkay ARDOĞAN***

* Assoc.Prof.Dr, Ege University, İzmir, Turkey, dilek.demirhan@ege.edu.tr

** Research Asst., Ege University, İzmir, Turkey, ozgur.babacan@ege.edu.tr

*** PhD Student, Ege University, İzmir, Turkey, rutkay@gmail.com

ABSTRACT

The aim of this study is analyzing the relationship between the financial self-efficacy, self-efficacy and financial literacy. A field study was conducted to fulfill this aim by applying questionnaires to 430 students at Faculty of Economics and Administrative Sciences in Ege University. Data collected were analysed by Structural Equation Modeling (SEM). According to the findings level of financial literacy does not have a significant effect on the level of financial self-efficacy alone, however self-efficacy and financial literacy together have a significant relationship with financial self-efficacy.

Keywords: *Financial Self-Efficacy, Financial Literacy, Self-Efficacy*

JEL Codes:

1. INTRODUCTION

Self-efficacy is defined as people's beliefs about their capabilities to produce designated levels of performance that exercise influence over events which affect their lives (Bandura, 1994). Bandura (1996) suggested that individuals who have high levels of self-efficacy would have stronger beliefs that are able to perform successfully on their tasks, and are better in dealing with failing experiences than people who have low levels of self-efficacy. In finance literature, a specific version of self-efficacy, "financial self-efficacy", is studied, which is briefly defined as individuals' perceived ability to handle their finances. According to Lapp (2010), financial self-efficacy is an integral element of financial capability and an individual is considered as financially capable if he is able to cover monthly expenses with his own income, track his spending, make plans for future and invest accordingly, select and manage financial products, gain and exercise financial knowledge (Lapp, 2010). Thus, financial knowledge is an important factor that is expected to have an effect on financial self-efficacy. Moreover, findings of Xiao (2016) reveals that financial education helps enhance financial self-efficacy. Financial knowledge and financial education concepts are closely related to "financial literacy". In fact, financial literacy is used interchangeably with terms financial knowledge and financial education by some researchers in the literature (Aren & Aydemir, 2014). In addition, there are many studies which consider financial knowledge and understanding as a key dimension of financial literacy (Titko & Lace, 2013). Therefore, a relationship may be expected between financial literacy level and financial self-efficacy. Based on this, the objective of the study is investigating the relationship between

**** Research Asst., Ege University, İzmir, Turkey, ceren.tatarlar@ege.edu.tr

financial literacy and financial self-efficacy. Accordingly a questionnaire is applied to 430 students studying at undergraduate and graduate studies of Department of Business Administration, Ege University. Three scales (Self-efficacy scale, financial literacy scale and financial self-efficacy scale) are used in questionnaire and data collected is analyzed using Structural Equation Model (SEM). Findings of the analysis reveal that level of financial literacy does not have a significant effect on the level of financial self-efficacy alone, however self-efficacy and financial literacy together have a significant relationship with financial self-efficacy

2.LITERATURE REVIEW

The concept of self-efficacy was suggested, developed and introduced to literature by social psychologist Albert Bandura (1977), who is also the contributor of major concepts like human agency, social cognitive theory, social learning theory and etc. As Bandura (1994) defined, self-efficacy is one's belief of himself about performing a certain task. The main information sources used by individuals to form self-efficacy are ranked as (1) performance accomplishments, (2) vicarious experience, (3) social persuasion, and (4) physiological and emotional states (Staples et al., 1998).

Self-efficacy may affect many areas of human life. For example, educational studies take self-efficacy into consideration within the framework of motivation, learning and even a specific concept for educational studies, academic self-efficacy (Bandura and Schunk, 1981; Schunk, 1989; Salomon, 1984; Zimmermann, 1995; Bandura, 1997; Pajares, 1997; Zimmermann, 2000). On the other hand, in management studies which are in the scope of organizational behavior or organizational psychology, the concept of self-efficacy was consulted for many researches. For example a specific version of self-efficacy has emerged through the years of studies, which is called "emotion work-related self-efficacy" (Heuven et al., 2006). On the other hand, in behavioral finance literature another specific version of self-efficacy is studied. "Financial self-efficacy" concerns individual responding to the financial problems and coping strategies.

Financial self-efficacy concept is quite fresh in behavioral finance literature. A research by Lapp (2010) and EARN Institute shows that financial self-efficacy links the knowledge and action. They conducted a 3 question survey. As a result of this it appeared that financial self-efficacy is a part of financial capability, which is defined by five factors (1) being able to cover monthly expenses with income; (2) tracking spending; (3) planning ahead and saving for the future; (4) selecting and managing financial products and services, and; (5) gaining and exercising financial knowledge (Lapp, 2010). Based on this definition, financial knowledge is considered as an important element of financial capability which is related to financial self efficacy.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Financial-Self Efficacy beliefs, analyzed by Lown's (2011) Financial-Self Efficacy scale applied to 1,542 Australian women between the ages of 30 and 60, it was found that there was an important predictor of retention of investment and savings products. (Farrell, Fry, & Risse, 2016). In addition, Australian women with higher Financial-Self Efficacy beliefs were more reluctant to hold debt-related products. Another research shows us the level of financial literacy enhancing an individual's financial self-efficacy (Lapp, 2010). Postmus (2011) pointed out the importance of financial self efficacy being as important as financial literacy to ensure control over personal financial actions.

Financial knowledge has become more important as new financial products and services grow and become diversified every day, because it has become easier for "ordinary citizens" to access financial markets around the world (Boshara et al., 2010). In addition, despite the fact that workers have only depended on social security systems, or employer sponsored pension funds for their savings for retirement in the past; nowadays workers have to build their own retirement savings plans themselves, thus facing more responsibility for saving and investing (McKenzie and Liersch, 2011).

Because of all these developments in finance, individuals are facing both advantages and greater responsibilities for saving, investing and borrowing decisions. As a result, it is getting crucial to invest in the ability called financial literacy, which may be shortly defined as being able to acknowledge all types of economic information and to make financial planning decisions based on this information (Hilgert et al., 2003; Morton 2005; Lusardi and Mitchell, 2007a; Cordray, 2013). Regarding the definition of financial literacy, Remund (2010) argues: "Financial literacy is a measure of the degree to which one understands key financial concepts and possesses the ability and confidence to manage personal finances through appropriate short-term decision-making and sound, long-range financial planning, while mindful of life events and changing economic conditions."

Although there has been much said about economics of education in the literature, unfortunately much less has been conducted on financial literacy, until recent years. Early studies conducted by Modigliani and Brumberg (1954) and Friedman (1957) claim that a fully rational and well-informed individual will try to smooth her marginal utility over her lifetime, by consuming less when her income is higher and saving in order to support her life when she is retired, thus arranging her saving patterns optimally. The main assumption behind these early models is that individuals can formulate and execute financial saving plans, because they have the capacity to understand complex information regarding financial markets and to manage dealing with economic calculations. However, not many people have that financial knowledge in reality, and also it is costly to have the education to get the necessary knowledge.

In the last few years, academia have begun to examine the decision process for acquiring financial literacy, also to study the links between financial knowledge, saving, and investment behavior (Delavande et al., 2008; Hsu 2011; Lusardi et al., 2013). It is now almost a consensus that financial literacy is an antecedent to various healthy financial behaviors of the individuals, such as understanding the basic principles of saving, or planning financial preparation for retirement (Adams and Rau, 2011). For example, Jappelli and Padula (2013) claim that financial literacy and wealth are strongly correlated over the life cycle of the individual, both increasing until retirement and decreasing afterwards. Moreover, they argue individuals have less incentive to save, thus have less reason to invest in financial literacy, especially in countries with generous social security benefits. Delavande et al. (2008) show that individuals optimally choose to invest in financial knowledge to gain access to higher-return assets, whenever there is a possibility of a portfolio selection. Also, in cases the individual gets a financial training, she identifies better performing assets easier and hires financial advisers more often.

There are several surveys conducted to measure the level of financial knowledge in different demographic groups of the population. For example, Lusardi and Mitchell (2006) have managed to add questions about financial literacy in the 2004 Health and Retirement Study (HRS). The survey, covering respondents who are 50 or older, shows that financial literacy among older individuals in the United States is very low. Hilgert and Hogarth (2002), have reached to similar results, examining financial literacy in a sample covering all age groups. Lusardi and Tufano (2008) show that the vast majority of respondents in a U.S. households sample have limited debt literacy. Running a cross-country study, Lusardi and Mitchell (2007b) argue that the level of financial literacy is low in many developed countries.

To summarize, theoretical and empirical literature on financial literacy have been making significant contribution, by especially focusing on the topics such as the decision, acquisition and the effects of financial knowledge, thus offering a novel approach to evaluate policy options. Furthermore, these studies offer new insights for the policymakers to be able to increase welfare by enhancing young individuals' endowment of financial knowledge. However, there are only a few studies in the literature, which links financial self-efficacy to financial literacy, to the best of our knowledge.

3.METHODOLOGY

Our study aims to focus on investigating the relationship between Financial Self Efficacy, Financial Literacy and Self Efficacy. A field study is conducted on undergraduate and graduate students and research question is basically, "Are the levels of financial literacy and self efficacy affect the financial self-efficacy perceived by the students in Ege University. The sample covers 430 graduate and

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

undergraduate students studying at Faculty of Economics and Administrative Sciences in Ege University. Collected data were analysed by using SPSS 22 program (Statistical Package for Social Science) and AMOS™ 21. Structural Equation Model (SEM) was used to establish the hypothesized relationship between Financial-self efficacy, Self Efficacy and Financial literacy.

The scales used in the questionnaire are Financial Self-Efficacy Scale, which was developed by Lown and consisted of 6 items likert scale, self-efficacy scale developed by Sherer et al. (1982) (which was translated into Turkish by Gözüm and Aksayan (1999)); Financial Literacy Scale developed by Lown, J.M. (2011). We have created a weighted average for evaluating the scores of Financial Literacy Scale named "İtoporan".

4.FINDINGS

When the demographic characteristics of the participants are concerned, 192 of the participants who answered the questionnaire were high school (44,7%), 196 were university/college (45,6%) and 42 (9.8%) were masters graduate. It is seen that 50.2% of the 430 participants are female (n = 216) and 49.8% male (n = 214) which is a regular distribution. While the average age of the participants was 25.8 years, 53% (n = 222) were between the ages of 19-24 and included approximately half of the total participants. Age distribution was 29% (n = 121) in the 19-24 age group, 11% (n = 47) in the 25-30 age group, 5% (n = 22) in the 31-36 age range and 2% (n = 9) is 37 and older.

High number of people taking the finance course is positive in terms of understanding how these financial literacy and financial self-efficacy levels differ according to those who do not take finance course. 52.7% of the participants are currently employed and 47.7% of them do not work. While 29.5% (n: 127) of the participants did not have any experience in business life, it was seen that 37.4% (n: 161) of them had 1-3 years of work experience. Considering that the participants are all students, it is meaningful that they have a work experience of 67% and average of 3 years. We can see the summarized frequencies on Table 1.

Table 1. Frequency Table

| Descriptive Statistics | | | |
|-----------------------------------|-------------------|------------|--------------|
| | | Frequency | Percent (%) |
| EDUCATION | High School | 192 | 44.7 |
| | University | 196 | 45.6 |
| | Master | 36 | 8.4 |
| | PhD | 6 | 1.4 |
| | Total | 430 | 100,0 |
| GENDER | Female | 216 | 50.2 |
| | Male | 214 | 49.8 |
| | Total | 430 | 100,0 |
| AGE | 19-24 | 222 | 53% |
| | 25-30 | 121 | 29% |
| | 31-36 | 47 | 11% |
| | 37-42 | 22 | 5% |
| | 43 and over | 9 | 2% |
| | Total | 421 | 100,0 |
| ATTENDED A FINANCE COURSE? | Yes | 193 | 45.5 |
| | No | 231 | 54.5 |
| | Total | 424 | 100 |
| WORKING? | Yes | 205 | 47.7 |
| | No | 225 | 52.3 |
| | Total | 430 | 100,0 |
| TOTAL WORK EXPERIENCE | No Experience | 127 | 29.5 |
| | 1-3 years | 161 | 37.4 |
| | 4-6 years | 58 | 13.5 |
| | 7-9 years | 31 | 7.2 |
| | 10 years and more | 53 | 12.3 |
| | Total | 430 | 100,0 |

Table 2. Differences in Terms of Gender

| Is there a significant difference between females and males? | Levene's Test for Equality of Variances | | t-test for Equality of Means | | | Mean | |
|--|---|------|------------------------------|-----|-----------------|--------|-------|
| | F | Sig. | t | df | Sig. (2-tailed) | Female | Male |
| Financial Self Efficacy | 0,192 | ,662 | -,758 | 418 | ,449 | 2,067 | 2,02 |
| Self Efficacy | ,116 | ,733 | -2,161 | 396 | ,031 | 2,32 | 2,41 |
| Financial literacy (fltoporan) | 1,682 | ,195 | -4,950 | 428 | ,000 | 12,68 | 15,06 |

Financial self-efficacy beliefs of female and male students are not significantly different. Male students have higher levels of self-efficacy and financial literacy.

Table 3. Differences in Terms of Education Level

| Is there a significant difference in terms of education level? | | | | | | |
|--|----------------|----------------|-----|-------------|-------|-------------|
| ANOVA | | Sum of Squares | df | Mean Square | F | Sig. |
| Financial Self Efficacy | Between Groups | ,101 | 3 | ,034 | ,099 | ,961 |
| | Within Groups | 142,607 | 416 | ,343 | | |
| | Total | 142,709 | 419 | | | |
| Self Efficacy | Between Groups | 4,192 | 3 | 1,397 | 8,468 | ,000 |
| | Within Groups | 65,020 | 394 | ,165 | | |
| | Total | 69,212 | 397 | | | |
| Financial Literacy | Between Groups | ,404 | 3 | ,135 | 2,740 | ,043 |
| | Within Groups | 20,956 | 426 | ,049 | | |
| | Total | 21,360 | 429 | | | |

According to the results of One-way Anova test, the degree of self-efficacy was found different among the education level for F=8,468, df=3 ve p=0,00 value between groups.

Table 4. Differences in Terms of Attending Finance Courses

| Is there a significant difference between students who have attended a finance course and who have not? | | Levene's Test for Equality of | | t-test for Equality of Means | | |
|---|-----------------------------|-------------------------------|-------|------------------------------|---------|-----------------|
| | | F | Sig. | t | df | Sig. (2-tailed) |
| Financial Self Efficacy | Equal variances assumed | 0.007 | 0.935 | 0.995 | 412 | 0.32 |
| | Equal variances not assumed | | | 0.992 | 396.093 | 0.322 |
| Self Efficacy | Equal variances assumed | 0.103 | 0.749 | 1.929 | 390 | 0.054 |
| | Equal variances not assumed | | | 1.914 | 363.635 | 0.056 |
| Financial Literacy | Equal variances assumed | 1.752 | 0.186 | -3.546 | 422 | 0.000 |
| | Equal variances not assumed | | | -3.524 | 397.432 | 0.000 |

As observed from Table 4, financial literacy level of those who take finance courses are higher than those who do not take any finance courses.

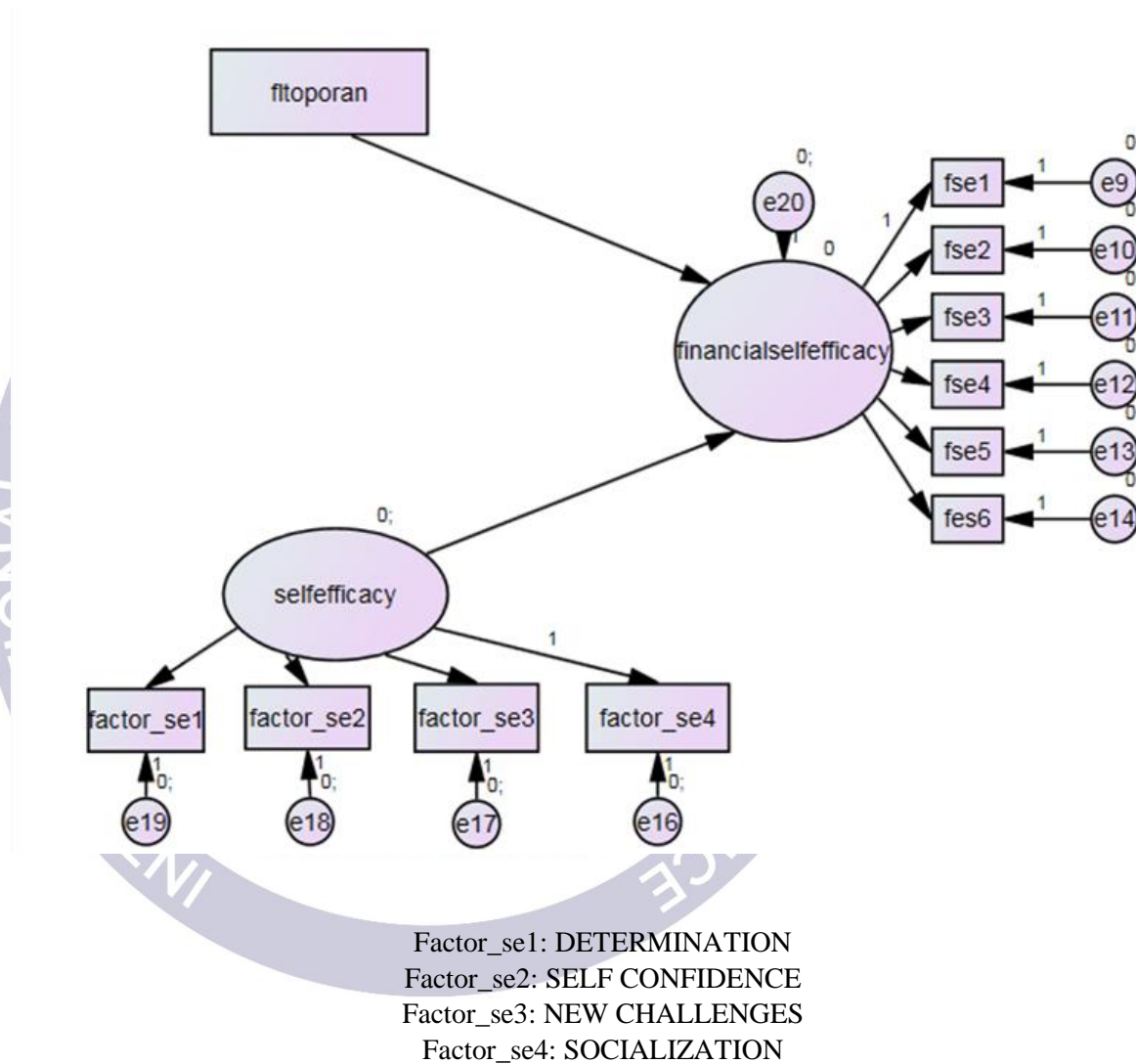
Table 5. Correlation Table

| Correlations | | | | |
|--------------|---------------------|-------------------------|---------------|--------------------|
| | | Financial Self Efficacy | Self Efficacy | Financial Literacy |
| AGE | Pearson Correlation | -,038 | -,167** | ,218** |
| | Sig. (2-tailed) | ,448 | ,001 | ,000 |
| | N | 411 | 389 | 421 |

It is understood that there is a strong relationship between age and self-efficacy beliefs and financial literacy level. Unsurprisingly, financial information with age and experience contributes to increasing financial literacy and self-efficacy levels of individuals

5.THE MODEL AND AMOS FINDINGS

By applying Explanatory Factor Analysis on questions related to self-efficacy, we have managed to reduce the data to four sets of summary variables, that is (i) determination, (ii) self-confidence, (iii) new challenges, and (iv) socialization.



Each question related to measurement of level of Financial Self Efficacy, total of six questions, has been used as a separate factor. Probability level of the model is lower than 0,05, thus we can claim that our model is significant (null hypothesis should be rejected).

Result (Default model)

Minimum was achieved

Chi-square = 85,115

Degrees of freedom = 43

Probability level = ,000

| | Factor | | | |
|--|--------|------|------|------|
| | 1 | 2 | 3 | 4 |
| se9 | ,754 | | | |
| se8 | ,695 | | | |
| se3 | ,615 | | | |
| se1 | -,547 | | | |
| se6 | ,481 | | | |
| se13 | ,356 | | | |
| se4 | | | | |
| se14 | | ,793 | | |
| se15 | | ,761 | | |
| se16 | | ,542 | | |
| se17 | | ,523 | | |
| se10 | | | ,706 | |
| se12 | | | ,659 | |
| se2 | | | | |
| se21 | | | | ,604 |
| se19 | | | | ,510 |
| Extraction Method: Maximum Likelihood. | | | | |
| Rotation Method: Promax with Kaiser Normalization. | | | | |
| a. Rotation converged in 6 iterations. | | | | |

Table 6. Regression Weights: (Group Number 1 - Default Model)

| | | | Estimate | S.E. | C.R. | P | Label |
|-----------------------|------|-----------------------|----------|------|-------|------|--------|
| financialselfefficacy | <--- | ftoporan | ,053 | ,106 | ,499 | ,618 | par_9 |
| financialselfefficacy | <--- | selfefficacy | ,533 | ,134 | 3,984 | *** | par_10 |
| fse1 | <--- | financialselfefficacy | 1,000 | | | | |
| fse2 | <--- | financialselfefficacy | 1,179 | ,130 | 9,071 | *** | par_1 |
| fse3 | <--- | financialselfefficacy | 1,118 | ,152 | 7,364 | *** | par_2 |
| fse4 | <--- | financialselfefficacy | 1,278 | ,133 | 9,608 | *** | par_3 |
| fse5 | <--- | financialselfefficacy | 1,038 | ,118 | 8,831 | *** | par_4 |
| fse6 | <--- | financialselfefficacy | 1,092 | ,143 | 7,655 | *** | par_5 |
| factor_se4 | <--- | selfefficacy | 1,000 | | | | |
| factor_se3 | <--- | selfefficacy | 2,774 | ,411 | 6,742 | *** | par_6 |
| factor_se2 | <--- | selfefficacy | 3,044 | ,448 | 6,787 | *** | par_7 |
| factor_se1 | <--- | selfefficacy | 3,189 | ,467 | 6,824 | *** | par_8 |

All variables in the model are statistically significant, we can argue that level of financial literacy does not have a significant effect on the level of financial self efficacy alone.

Table 7: Standardized Regression Weights: (Group number 1 - Default model)

| | | | Estimate |
|-----------------------|------|-----------------------|----------|
| financialselfefficacy | <--- | ftoporan | ,026 |
| financialselfefficacy | <--- | selfefficacy | ,296 |
| fse1 | <--- | financialselfefficacy | ,535 |
| fse2 | <--- | financialselfefficacy | ,657 |
| fse3 | <--- | financialselfefficacy | ,471 |
| fse4 | <--- | financialselfefficacy | ,753 |
| fse5 | <--- | financialselfefficacy | ,625 |
| fse6 | <--- | financialselfefficacy | ,498 |
| factor_se4 | <--- | selfefficacy | ,339 |
| factor_se3 | <--- | selfefficacy | ,801 |
| factor_se2 | <--- | selfefficacy | ,836 |
| factor_se1 | <--- | selfefficacy | ,877 |

The table above shows us the regression coefficients of financial literacy and self efficacy on financial self efficacy. Hence, we can write our regression model as follows:

$$\text{Financial Self Efficacy} = 0,296 \times \text{Self Efficacy} + 0,026 \times \text{Financial Literacy} + e$$

CMIN/DF value of our model is 1,979, which is lower than the critical value 3, proving that our model has a good fit.

Table 8: Baseline Comparisons

| Model | NFI | RFI | IFI | TLI | CFI |
|--------------------|--------|------|--------|------|-------|
| | Delta1 | rho1 | Delta2 | rho2 | |
| Default model | ,937 | ,919 | ,968 | ,958 | ,967 |
| Saturated model | 1,000 | | 1,000 | | 1,000 |
| Independence model | ,000 | ,000 | ,000 | ,000 | ,000 |

In a similar way, all the values of the “default model” is higher than the critical value 0,9, another point showing the level of our model fit is high.

Table 9: RMSEA

| Model | RMSEA | LO 90 | HI 90 | PCLOSE |
|--------------------|-------|-------|-------|--------|
| Default model | ,048 | ,033 | ,063 | ,576 |
| Independence model | ,234 | ,224 | ,245 | ,000 |

Lastly, RMSEA value of the model (0,048) is lower than the critical value 0,08. Again, we can conclude that our data is a good fit for the model we have derived.

6.CONCLUSION

The purpose of the study is finding out whether increasing financial literacy level allows a person to overcome any financial difficulties and increase financial prosperity. According to the results of analysis as seen, Financial self-efficacy level of the participants are affected by financial literacy level and level of self efficacy beliefs together. As expected, there is a significant relationship between self-efficacy and financial self-efficacy. However, we are surprised by the weak relationship between financial literacy and financial self-efficacy. Moreover, the expected assumption is that people with high financial literacy should be more self-confident in this area, but our results do not support this assumption.

The average financial self-efficacy level of 2.04 (average value: 2.5), indicates that the perceptions of financial self-efficacy of participants are not low. This situation shows us that no matter financial literacy level is high or not, participant has the same beliefs in financial self-efficacy. As a result, it reinforces the idea that the participants are self-confident in financial issues even if they have no competency about them.

REFERENCES

- Adams, G. A. & B. L. Rau. (2011) "Putting Off Tomorrow to Do What You Want Today: Planning for Retirement". *Amer. Psychologist*. 66(3): 180-192.
- Aren, S., & Aydemir, S. D. (2014) "A Literature Review On Financial Literacy", *Finansal Araştırmalar ve Çalışmalar Dergisi*, 5(11): 33-49.
- Bandura, A. (1977) "Self-Efficacy: Toward a Unifying Theory of Behavioral Change". *Psychological Review*, 84: 191-215.
- Bandura, A. (1994) "Social Cognitive Theory of Mass Communication". In J. Bryant & D. Zillman (Eds.), *Media Effects: Advances in Theory and Research* Hillsdale, NJ: Erlbaum: 61-90.
- Bandura, A. (1996) "Social Cognitive Theory of Human Development". In T. Husen & T. N. Postlethwaite (Eds.), *International Encyclopedia of Education* Oxford: Pergamon Press. (2): 5513-5518.
- Bandura, A. (1997) "Self-Efficacy: The Exercise of Control". New York: Freeman.
- Bandura, A. & Schunk, D. H. (1981) "Cultivating Competence, Self-efficacy, and Intrinsic Interest Through Proximal Self-motivation". *Journal of Personality and Social Psychology*, 41: 586-598.
- Boshara, R., Gannon, J., Mandell, L., Phillips J. W. R. & Sass S. (2010) "Consumer Trends in The Public, Private and Nonprofit Sector". Working Paper, National Endowment for Financial Education, Denver, CO.
- Cordray, R. (2013) "Prepared Remarks of Richard Cordray, Director of the Consumer Protection Bureau". Council for Economic Education, Annual Financial Literacy and Economic Education Conference. Baltimore, Maryland. October 3, 2013.
- Delavande, A., Susann R., & Willis, R. (2008) "Preparation for Retirement, Financial Literacy and Cognitive Resources." University of Michigan Retirement Research Center Working Paper. 2008-190.
- Farrell, L., Fry, T. R. L., & Risse, L. (2016) "The Significance of Financial Self-Efficacy in Explaining Women's Personal Finance Behaviour. *Journal of Economic Psychology*, 54: 85-99.
- Forbes, J. & Kara, S. M. (2010) "Confidence Mediates How Investment Knowledge Influences Investing Self-Efficacy", *Journal of Economic Psychology*, 31: 435-443.
- Friedman, M. (1957) "A Theory of the Consumption Function". Princeton: Princeton University Press.
- Heuven, E., Bakker, A. B., Schaufeli, W. B. & Huisman, N. (2006) "The role of Self-efficacy in Performing Emotion Work". *Journal of Vocational Behavior*, 69: 222-235.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Hilgert, M. & Hogarth, J. (2002) "Financial Knowledge, Experience and Learning Preferences: Preliminary Results from A New Survey on Financial Literacy". *Consumer Interests Annual*. 48: 1-7.
- Hilgert, M., Hogarth, J. M. & Beverly, S. (2003) "Household Financial Management: The Connection between Knowledge and Behavior". *Fed. Res. Bull.* 89(July): 309–322.
- Hira, T. (2010) *The NEFE Quarter Century Project: Implications for researchers, educators, and policy makers from a quarter century of financial education*. National Endowment for Financial Education.
- Hsu, J. W. (2011) "Aging and Strategic Learning: The Impact of Spousal Incentives on Financial Literacy." *Indiana State University Networks Financial Institute Working Paper*, 2011-WP-06.
- Jappelli, T. & Padula, M. (2013) "Investment in Financial Literacy and Saving Decisions." *Journal of Banking and Finance*. 37(8): 2779–92.
- Lapp, W. M. (2010) "Behavior Models for Prosperity: A Statistical Assessment of Savings and Behavioral Change". *EARN Research Brief*. San Francisco, CA: Earned Assets Resource Network.
- Lapp, W. M. (2010) "The Missing Link: Financial Self-Efficacy's Critical Role in Financial Capability", *EARN Research Institute*.
- Lusardi, A. & Mitchell, O. S. (2006) "Financial Literacy and Planning: Implications for Retirement Wellbeing." *Working Paper*, Pension Research Council, Wharton School, University of Pennsylvania.
- Lusardi, A. & Mitchell, O. S. (2007a). "Baby Boomers Retirement Security: The Role of Planning, Financial Literacy and Housing Wealth". *Journal of Monetary Economics*. (54): 205-224.
- Lusardi, A. & Mitchell, O. S. (2007b) "Financial Literacy and Retirement Preparedness: Evidence and Implications for Financial Education". *Business Economics*. (42): 35-44.
- Lusardi, A. & Tufano, P. (2008) "Debt Literacy, Financial Experience, and Overindebtedness." *Mimeo*, Harvard Business School.
- Lusardi, A., Michaud, P. C. and Mitchell, O. S. (2013) "Optimal Financial Knowledge and Wealth Inequality." *National Bureau of Economic Research Working Paper* 18669.
- McKenzie, C. R. M. and Liersch, M. J. (2011) "Misunderstanding Savings Growth: Implications for Retirement Savings Behavior". *J. Marketing Res.* 48(Special Issue): 1-13.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Mindra, R., Moya, M., Zuze, L. T., and Kodongo, O. (2017) "Financial Self-Efficacy: a Determinant of Financial Inclusion". *International Journal of Bank Marketing*, 35(3): 338-353.
- Modigliani, F. and Brumberg, R. (1954) "Utility Analysis and the Consumption Function: An Interpretation of Cross-Section Data." In *Post-Keynesian Economics*, edited by Kenneth K. Kurihara, 388-436. New Brunswick: Rutgers University Press.
- Morton, J. S. (2005) "The Interdependence of Economic and Personal Finance Education". *Social Education*. 69(2): 66-70.
- Xiao, J. J. (2016) "Financial Education and Financial Satisfaction: Financial Literacy, Behavior, and Capability as Mediators", *International Journal of Bank Marketing*, 35(5): 805-817.
- Remund, D.L. (2010) "Financial Literacy Explicated: The Case for A Clearer Definition in An Increasingly Complex Economy". *J. Consum. Aff.* (44): 276-295.
- Pajares, F. (1997) "Current Directions in Self-efficacy Research". In M. Maehr & P. R. Pintrich (Eds.), *Advances in Motivation and Achievement* 10: 1749. Greenwich, CT: JAI Press.
- Postmus, J. L. (2011) "Understanding Financial Literacy with Survivors of Intimate Partner Violence", CFS Issue Brief http://www.cfs.wisc.edu/briefs/Postmus2011_ResearchBrief.pdf.
- Salomon, G. (1984) "Television Is "Easy" and Print Is "Tough": The Differential Investment of Mental Effort in Learning As A Function of Perceptions And Attributions". *Journal of Educational Psychology*, 76: 647-658.
- Schunk, D. H. (1989) "Self-efficacy And Cognitive Skill Learning". In C. Ames & R. Ames (Eds.), *Research on Motivation in Education. Vol. 3: Goals and Cognitions* San Diego: Academic, 13-44. Press.
- Sherer M et al. (1982) "The Self-Efficacy Scale Construction and Validation", *Psychological Reports*, 51: 663-71.
- Staples, D. S., Hulland, J. S. and Higgins, C. A. (1998) "A Self-Efficacy Theory Explanation for The Management of Remote Workers in Virtual Organizations". *Journal of Computer-Mediated Communication*, 3.
- Titko, J., & Lace, N. (2013) "Financial Literacy: Building a Conceptual Framework", *Liberec economic forum 2013: proceedings of the 11th international conference*, 585-592.
- Zimmerman, M. A. (1995) "Psychological Empowerment: Issues and Illustrations". *American Journal of Community Psychology*, 23 (October): 581-602.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Zimmerman, B. J. (2000) "Attainment of Self-regulation: A Social Cognitive Perspective". In M. Boekaerts, P.R. Pintrich, & M. Zeidner (Eds.), Handbook of self-regulation (pp. 13-39). San Diego, CA: Academic Press.



**THE EFFECT OF HUMAN CAPITAL ON HUMAN DEVELOPMENT INDEX IN TURKEY:
AN EMPIRICAL ANALYSIS¹⁶**

Hale Kırer SILVA L.*

Özlem AYVAZ KIZILGÖL**

ABSTRACT

In recent years, Human Development Index (HDI) is one of the most crucial indices used to measure the level of development of countries. The aim of this study is to investigate the effects of education and health expenditures, which are the most fundamental components of human capital on HDI. We analyze the HDI, total education expenditures as % of Gross Domestic Product (GDP) and total health expenditure as % of GDP data annually for the period between 1990 and 2017. Analysis results show that there is a unidirectional causality towards education and health expenditures from HDI and from education expenditures to health expenditures. While the impact of a standard deviation shock of education expenditures on the HDI is generally negative, the effect of a standard deviation shock of health expenditures is positive. Moreover, while 99% of the change in the HDI is explained by itself in the first period, results differ for the last period. Accordingly, 72% of the change in this variable is explained by itself, 21% by health expenditures and 7% by education expenditures.

Keywords: Human Development Index, Human capital, Time Series analysis.

JEL Codes: I15, I25, O15

1.INTRODUCTION

Nowadays, HDI is one of the main concerns in both developed and developing countries. The United Nations Development Programme (UNDP) categorize countries according to their HDI value (Table 1) in the Human Development Report (HDR). In this report, Turkey is ranked 64th among 189 countries with the HDI value of 0,791; 56th among 151 countries with the inequality adjusted HDI value of 0,669; 68th among 183 countries with the inequality-adjusted life expectancy index value of 0,779; 80th among 168 countries with the inequality adjusted education index value of 0.575 in 2017 (<http://hdr.undp.org/en/composite/HDI>).

¹⁶ Bu Çalışma Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi BAP (Bilimsel Araştırma Projeleri Koordinasyon) Birimi tarafından desteklenmiştir. Proje No: BAP-18-İİBF-1009-121

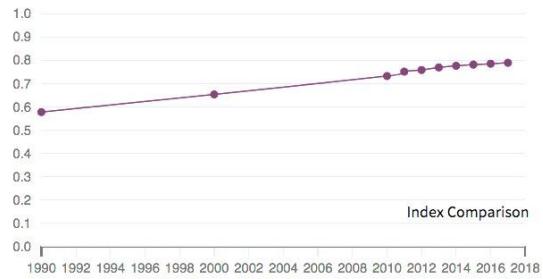
* Assistant Professor Dr., Bandırma Onyedli Eylül University, Balıkesir, Turkey, hkirer@bandirma.edu.tr

** Assistant Professor Dr., Bandırma Onyedli Eylül University, Balıkesir, Turkey, okizilgol@bandirma.edu.tr

Table 1. Categorization of Countries

| HDI Value (x) | |
|---------------------|-----------------------------|
| $\geq 0,8$ | Very High Human Development |
| $0,7 \leq x < 0,8$ | High Human Development |
| $0,55 \leq x < 0,7$ | Medium Human Development |
| $x < 0,55$ | Low Human Development |

Figure 1. HDI in Turkey



Source: UNDP

When the human capital is defined as the value of human qualification, everything that helps to improve it is a factor of human capital; including education, health, nutrition and immigration (Altay and Pazarlıoğlu, 2007: 99). However, education and health are accepted as fundamental components. It is very important how much you invest on those components since their external properties have a great influence on development. According to Lucas (1988) an increase in human capital has a both internal and external effect; which means it both increases individual's own productivity and productivity of all factors of production. Grossman (1972) make a separation between health and education. He argues that a person's stock of knowledge affects his market and nonmarket productivity; while his stock of health determines the total amount of time he can spend producing money earnings and commodities.

In the new millenium the value of information has been increasing day by day. This requires more investment aimed to obtention, distribution and the use of knowledge. At that point education expenditures gain more importance to improve skills of individuals.

The aim of this study is to investigate the effects of education and health expenditures on HDI and to demonstrate the relationships between them. There are many studies in the literature examining the relationship between human capital and economic growth. In these studies, only the effects of health expenditures or only education expenditures or both on the economic growth were evaluated. However, there are not empirical studies researching the effects of education and health expenditures on HDI in Turkey. Our empirical study aims to fill up the gap in this area. Within this framework the following section reviews the literature. In the third section, firstly, we introduce the data and variables, and then give the results with their interpretations. We finish the paper with our conclusions and recommendations.

2.LITERATURE

The studies in this area are mostly performed for developing countries. Gupta, Verhoeven and Tiongson (2002) examined the effectiveness of government spending on education and healthcare. They

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

pointed out that there was a relationship between increasing education expenditures and increasing number of enrollments to school and there was a relationship between increasing health expenditures and decreasing infant mortality in 50 developing countries. Opreana and Mihaiu (2011) tested the correlation between the effects, effort and efficiency of health expenditure in the European Union and HDI. They observed a bilateral relationship between health expenditure and HDI. Freire and Kajiura (2011) investigated the impact of public and private health expenditure on the health related millennium development goals. According to authors, the public health expenditure affected the health development among other socio-economic variables. The study also pointed out that the UN Millenium Development had a strong impact on development of health indicators. Razmi, Abbasian and Mohammadi (2012) analyzed the effect of government health expenditures on HDI by using the Ordinary Least Squares Method over the period 1990-2009 in Iran. They found that there was a positive and significant relationship between government health expenditure and HDI; however, the Granger Causality test results revealed that there was no bilateral relationship between these variables in Iran. Prasetyo and Zuhdi (2013) analyzed the efficiency level of government expenditures per capita in health and education sectors and transfers and subsidies in 81 countries towards the human development by using Data Envelopment Analysis (DEA) approach for the period 2006-2010. They determined that many countries were always positioned in the efficient frontier during the analyzed years. Iheoma (2014) conducted a fixed effect panel data model and regressed the HDI on health and education spendings for 20 selected sub-Saharan African countries by using the ordinary least square estimation. He pointed out that only public health and tertiary education spending were significant in explaining human development in the analyzed countries while private health spending as well as primary and secondary education expenditures were found to be insignificant. Sudirman (2017) examined the effect of government expenditures in education and health against HDI in Indonesia for the years between 2001 and 2015 by generating a multiple regression model. He found that there was a positive impact from government expenditures in education and health sectors to the HDI and there is no influence of government expenditure in field education on the HDI. On the other hand, he found a positive and significant effect from government expenditure in health sector to HDI. Pahlevi (2017) also analyzed the impact of governance and government expenditure (health and education) on human development by using panel data from 33 provinces in Indonesia for the period 2008 - 2012. She used a Regression and Exploratory Data Analysis (EDA) approach to examine the relationship. In conclusion she found a positive effect of governance on HDI and also revealed that education expenditure affected HDI significantly in positive direction, while health expenditure in negative direction.

In Turkey studies mostly focus on the effects of human capital on economic growth. These studies in general evaluate either only health – economic growth relationship [Taban (2006), Kıymaz, Akbulut and Demir (2006), Erdoğan and Bozkurt (2008), Sülkü and Caner (2009), Tıraşoğlu and Yıldırım (2012),

Ak (2012), Yardımcıoğlu (2012), Ay, Kızılkaya and Koçak (2013), Çalışkan, Karabacak and Meçik (2013), Selim, Uysal and Eryiğit (2014), Akar (2014), Uçan and Atay (2016), Atılğan, Kılıç and Ertuğrul (2017)] or only education – economic growth relationship [Pamuk and Bektaş (2014), Kızılkaya and Koçak (2014)] or both [Bozkurt (2010), Karataş and Çankaya (2011), Başar, Künu and Bozma (2016)]. The number of the studies related to HDI is limited and mostly tends to be theoretical in Turkey. Çalışkan (2010) analyzed the relationship between human capital and human development in Turkey in terms of education, health and income indices. Ünalın investigated the effect of growth, change in Gini coefficient, government expenditures per capita and labor force participation rate on the human development. He performed the analysis by using a panel data on annual basis for 114 countries. According to his findings, human development had a positive relationship with growth and government expenditures per capita and a negative relationship with Gini coefficient. There was not a significant relationship between labor force participation rate and human development. Yılmaz and Danişoğlu (2017) examined the role of human capital on economic and human development. They considered HDI as proxy of human development and summarize the human capital profile of Turkey in terms of health, education, and income. Yalçın and Çakmak (2016) examined the effect of public health expenditures on human development by using Regression Analysis. They employed the ratio of public health expenditures in GDP, the number of patients per doctor and medical institutions with bed for the period 1991-2013. They pointed out that public health expenditures had a significant effect on human development. İkiz (2016) made a theoretical research to investigate the relationship between health expenditures both in public and private sectors and human development in Turkey.

3. ANALYSIS

In this section we analyze empirically the effect of human capital on HDI annually for the years between 1990 and 2017.

3.1. Data Set and Variables

We use the ratio of total education expenditures and the total health expenditures in GDP as proxy of human capital and Human Development Index. In the analysis HDI, EDUCATION and HEALTH indicate respectively Human Development Index, the ratio of total education expenditures in GDP and the ratio of total health expenditures in GDP. We gather the HDI data from UNDP's HDR, EDUCATION data from Turkish Stats and IndexMundi and HEALTH data from, TurkStats and World Health Organization (WHO). Since UNDP has been calculating HDI since 1990, we begin our analysis from the stated year on.

3.2. Empirical Results

The empirical part of the study includes Time Series Analysis. In this study, Unit Root Tests, Granger Causality Test, Impulse-Response Analysis and Variance Decomposition Analysis were

performed. Augmented Dickey-Fuller (ADF), Phillips-Perron (PP), Kwiatkowski-Phillips-Schmidt-Shin (KPSS) and Ng-Perron Unit Root tests were applied to the variables used in the study. The results of the Unit Root Tests are shown in Table 2.

Table 2. Unit Root Test Results

| Variable | ADF | PP | KPSS | NG-PERRON | | | | Decision |
|-----------|---|--|--|---|--|--|--|----------|
| | | | | MZ_a | MZ_t | MSB | MPT | |
| HDI | Level 0.280(0) ^c 1.Dif. -3.631 ^{**} (0) ^c | Level -2.537(1) ^b 1.Dif. -3.642 ^{**} (1) ^c | Level 0.102 [*] (2) ^b | Level -2.271(1) ^c 1.Dif. -10.893 ^{**} (0) ^c | Level -0.793(1) ^c 1.Dif. -2.313 ^{**} (0) ^c | Level 0.349(1) ^c 1.Dif. 0.212 ^{**} (0) ^c | Level 8.989(1) ^c 1.Dif. 2.330 ^{**} (0) ^c | I(1) |
| EDUCATION | Level -3.519(0) ^b 1.Dif. -4.912 [*] (1) ^c | Level -3.508(2) ^b 1.Dif. -7.983 [*] (9) ^c | Level 0.094 [*] (1) ^b | Level -11.331(0) ^b 1.Dif. -21.990 [*] (1) ^c | Level -2.367(0) ^b 1.Dif. -3.266 [*] (1) ^c | Level 0.209(0) ^b 1.Dif. 0.149 [*] (1) ^c | Level 8.108(0) ^b 1.Dif. 1.281 [*] (1) ^c | I(1) |
| HEALTH | Level 1.396(4) ^b 2.Dif. -3.988 ^{**} (5) ^b | Level 0.356(2) ^b 2.Dif. -6.698 [*] (1) ^c | Level 0.163 [*] (4) ^b | Level -4.294(1) ^c 2.Dif. -11.535 ^{**} (0) ^c | Level -1.462(1) ^c 2.Dif. -2.402 ^{**} (0) ^c | Level 0.341(1) ^c 2.Dif. 0.208 ^{**} (0) ^c | Level 5.710(1) ^c 2.Dif. 2.124 ^{**} (0) ^c | I(2) |

Note 1 The numbers in paranthesis "(.)" are the lag lengths that are determined by AIC in ADF test. Bartlett Kernell estimation method is used in PP and NG-Perron tests, bandwidth is determined as Newey-West. a: denotes that regression does not involve constant term or trend; b: denotes regression involves both constant term and trend; c: denotes regression involves constant term. *, **, indicates 1% and 5% significance level.

Unit Root Tests show that HDI and EDUCATION variables are first order stationary, and HEALTH variable is second order stationary. We adopt the information criteria to select the lag length. Accordingly Table 3 demonstrates the results.

Table 3. Lag Length According to Information Criteria

| Lag | LogL | LR | FPE | AIC | SC | HQ |
|-----|----------|-----------|-----------|------------|------------|------------|
| 0 | 4.033813 | NA | 0.000184 | -0.086151 | 0.061106 | -0.047084 |
| 1 | 104.2439 | 167.0169* | 9.29e-08* | -7.686994* | -7.097967* | -7.530725* |
| 2 | 106.7528 | 3.554219 | 1.67e-07 | -7.146066 | -6.115269 | -6.872595 |
| 3 | 114.4048 | 8.927386 | 2.08e-07 | -7.033736 | -5.561169 | -6.643064 |
| 4 | 128.3157 | 12.75161 | 1.73e-07 | -7.442974 | -5.528636 | -6.935100 |

Note 2 * indicates lag order selected by the criterion. LR: Sequential Modified LR Test Statistic, FPE: Final Prediction Error, AIC: Akaike Information Criteria, SC: Schwarz Information Criteria, HQ: Hannan-Quinn Information Criteria.

According to Table 3, the optimum lag length is 1. We test if there is an autocorrelation and heteroskedasticity with 1-lag length. We also investigate if inverse roots are within the unit circle. Within this framework Table 4 shows the results of the LM autocorrelation test, Table 5 White Heteroskedasticity test, and Figure 2 inverse roots.

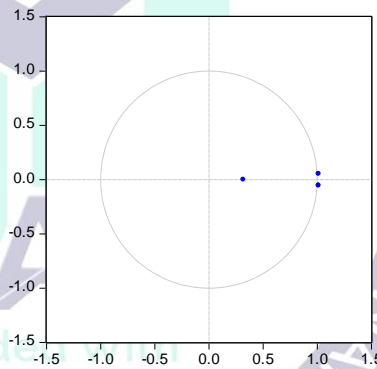
Table 4. LM Autocorrelation Test Results

| Lag | LM stat. | Prob. | Lag | LM stat. | Prob. | Lag | LM stat. | Prob. |
|-----|----------|--------|-----|----------|--------|-----|----------|--------|
| 1 | 9.783946 | 0.3683 | 5 | 10.99915 | 0.2758 | 9 | 5.82924 | 0.7569 |
| 2 | 9.327779 | 0.4076 | 6 | 12.85296 | 0.1694 | 10 | 10.02157 | 0.3487 |
| 3 | 8.849663 | 0.4513 | 7 | 5.263402 | 0.8108 | 11 | 4.632828 | 0.8651 |
| 4 | 6.579624 | 0.6808 | 8 | 4.434656 | 0.8806 | 12 | 19.81594 | 0.0191 |

Table 5. White Heteroskedasticity Test Results

| Chi-Sq | df | Prob. |
|--------|----|-------|
| 67.996 | 54 | 0.095 |

Figure 2. Inverse Roots for VAR Model



According to Table 4, there is no autocorrelation and there is no heteroskedasticity according to Table 5 at a 5% significance level in 1 lag length. Referring to Figure 2, the inverse unit roots of the model remain within the unit circle at this lag length. As a result, the optimal lag length is determined as 1. We perform Granger Causality test after we meet the prerequisites for VAR model. The results of this test are presented in Table 6.

Table 6. Granger Casualty Test Results

| Null Hypothesis | Obs. | F-Statistic | Prob. |
|---|------|-------------|---------|
| HEALTH does not Granger Cause HDI | 27 | 1.303 | 0.265 |
| HDI does not Granger Cause HEALTH | | 5.095 | 0.033** |
| EDUCATION does not Granger Cause HDI | 27 | 0.232 | 0.635 |
| HDI does not Granger Cause EDUCATION | | 10.137 | 0.004* |
| EDUCATION does not Granger Cause HEALTH | 27 | 15.107 | 0.0007* |
| HEALTH does not Granger Cause EDUCATION | | 2.863 | 0.104 |

Note 3: *, **; indicates 1% and 5% significance level.

According to the Granger causality test, there is a one-way causality relationship from HDI to HEALTH and EDUCATION and from EDUCATION to HEALTH. In other words, HDI is the cause of health and education expenditures. Following this part, the impulse-response analysis was performed and Figure 3 shows the obtained results.

Figure 3. Impulse – Response Functions

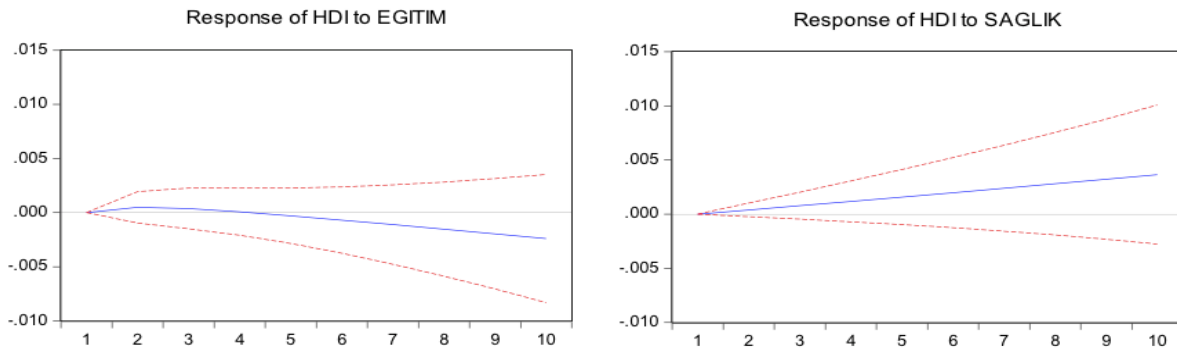


Figure 3 shows the response of HDI to one standard deviation shock in EDUCATION and HEALTH expenditures. It is observed that one standard deviation shock in EDUCATION expenditures affect the HDI positively until the 4th period, then it follows an increasingly negative path for the subsequent periods. The response of the HDI to one standard deviation shock in HEALTH expenditures constantly increases in the analyzed period. Finally we examine Variance Decomposition Analysis in the empirical part of the study. Table 7 illustrates Variance Decomposition results for HDI variable.

Table 7. Variance Decomposition Results for HDI Variable

| Period | S.E. | EDUCATION | HDI | HEALTH |
|--------|----------|-----------|----------|----------|
| 1 | 0.253754 | 0.000000 | 100.0000 | 0.000000 |
| 2 | 0.268224 | 0.775105 | 98.73221 | 0.492681 |
| 3 | 0.271325 | 0.826523 | 97.52919 | 1.644289 |
| 4 | 0.273417 | 0.617720 | 95.96165 | 3.420627 |
| 5 | 0.275590 | 0.589502 | 93.66629 | 5.744213 |
| 6 | 0.277999 | 0.955896 | 90.54266 | 8.501446 |
| 7 | 0.280709 | 1.780408 | 86.66117 | 11.55842 |
| 8 | 0.283787 | 3.040557 | 82.18104 | 14.77840 |
| 9 | 0.287301 | 4.668703 | 77.29481 | 18.03649 |
| 10 | 0.291318 | 6.578293 | 72.19253 | 21.22918 |

In the first period, 100% of the prediction error variance of the HDI variable is explained by itself; in the second period, 99% by itself, 0.78% by EDUCATION and 0.49% by HEALTH. EDUCATION variable effects the prediction error variance of HDI until sixth period both in positive and negative direction. However HEALTH variable has a constant positive impact on the prediction error variance of the HDI for all the analyzed years. The HEALTH variable also describes a larger percentage of HDI's prediction error variance when it is compared with the EDUCATION variable. In the 10th period, 72% of the changes in HDI arise from itself, while 7% is from EDUCATION and 21% from HEALTH. The results obtained from this analysis are consistent with the results of the impulse-response analysis.

4. CONCLUSION

The dimensions of development in a country have changed along with the publication of HDR indicator by UNDP in 1990 for the first time. Since then human criteria and values have been taken more seriously into consideration to determine the development levels of countries. HDI has brought the concept of human-centralized development into question and based on the different aspects of human and community life. It is calculated by analyzing three-dimensional human values, which are long and healthy life (life expectancy index), information (education index) and a good standard of living (GNI index).

In this study, we consider human capital in terms of human values. Our purpose is to investigate the effect of human capital on HDI for the period 1990-2017 in Turkey and to reveal the relationships between the variables. We use the ratio of total education expenditures to GDP and the ratio of total health expenditures to GDP as a proxy of the human capital variable. In this context we run a time series. The results show that there is a one-way causality relationship from HDI to education and health expenditures. Moreover while one standard deviation shock in the education expenditures affects HDI both negative and positively, the effect of one standard deviation shock in health expenditures on the HDI continuously increase positively. Our results imply that health expenditures have more impact than education expenditures to explain changes in HDI. While HDI's prediction error variance is explained only by itself in the first period; 72% of the changes by itself, 7% is by EDUCATION and 21% by health in the 10th period.

Our findings show that health spendings in Turkey have positive impact on human development, while education expenditures have a negative impact. In 2003 a new health care reform started to be implemented as "Health Transformation Program". This program has provided significant benefits in terms of healthcare services to all individuals no matter their financial situation. These reforms are reflected in HDI values. Frequently changing education system in Turkey also reflects in the HDI. Although the education expenditure share in GDP has been increasing in the analyzed years, the result

shows that it is not allocated effectively. On the other hand, it should be pointed out that the share allocated to health and education spending in Turkey is well below the OECD average. This situation reveals the necessity of economic remedy implementations in both education and health, which are accepted as basic dynamics of human capital. Therefore, policymakers both in public and private sector should not ignore this in their long-run plans. Particularly government should efficiently allocate more from the budget to have a better living standard in Turkey.

REFERENCES

- Ak, R. (2012) "The Relationship Between Health Expenditures and Economic Growth: Turkish Case", *Int. J. Bus. Mgt. Eco. Res. (IJBMER)*, 3 (1): 404-409.
- Akar, S. (2014) "Türkiye'de Sağlık Harcamaları, Sağlık Harcamalarının Nisbi Fiyatı ve Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişkinin İncelenmesi", *Celal Bayar Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Yönetim ve Ekonomi Dergisi*, 21 (1): 311-322.
- Altay, A. and Pazarlıoğlu, M. V. (2007) "Uluslararası Rekabet Gücünde Beşeri Sermaye: Ekonometrik Yaklaşım", *Selçuk Üniversitesi Karaman İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 12 (9): 96-108.
- Atılgan, E., Kılıç, D. and Ertuğrul, H. M. (2017) "The Dynamic Relationship Between Health Expenditure and Economic Growth: Is the Health-Led Growth Hypothesis Valid for Turkey?", *The European Journal of Health Economics*, 18: 567-574.
- Ay, A., Kızılkaya, O. and Koçak, E. (2013) "Sağlık Göstergeleri ve Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişki: Türkiye Örneği", *Niğde Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 6 (1): 163-172.
- Başar, S., Künu, S. and Bozma, G. (2016) "Eğitim ve Sağlık Harcamalarının Ekonomik Büyüme Üzerine Etkisi: Türkiye Üzerine Bir Uygulama", *Iğdır Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi*, 10: 189-204.
- Bozkurt, H. (2010) "Eğitim, Sağlık ve İktisadi Büyüme Arasındaki İlişkiler: Türkiye İçin Bir Analiz", *The Journal of Knowledge Economy & Knowledge Management*, 5: 7-27.
- Freire, C. and Kajiura, N. (2011) "Impact of Health Expenditure on Achieving the Health-related MDGs", *MPDD Working Paper Series WP/11/19*, United Nations Economic and Social Commission for Asia and the Pacific (ESCAP), 1-28.
- Çalışkan, Ş. (2010) "Türkiye'de Beşeri Sermaye Harcamaları ve İnsani Gelişmişlik", *ISGUC The Journal of Industrial Relations and Human Resources*, 12 (1): 7-28.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Çalışkan, Ş., Karabacak, M. and Meçik, O. (2013) "Türkiye'de Sağlık-Ekonomik Büyüme İlişkisi", Dumlupınar Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 37: 123-130.
- Erdoğan, S. and Bozkurt, H. (2008) "Türkiye'de Yaşam Beklentisi-Ekonomik Büyüme İlişkisi: ARDL Modeli ile Bir Analiz", Bilgi Ekonomisi ve Yönetimi Dergisi, 3 (1): 25-38.
- Grossman, M. (1972) "On the Concept of Health Capital and the Demand for Health", Journal of Political Economy, 80 (2): 223-255.
- Gupta, S., Verhoeven, M. and Tiongson, E. R. (2002) "The Effectiveness of Government Spending on Education and Health Care in Developing and Transition Economies", European Journal of Political Economy, 18 (4): 717-737.
- Iheoma, C. G. (2014) "Impact of Social Spending on Human Development in Sub-Saharan Africa", American Journal of Social Sciences, 2 (2): 29-35.
- IndexMundi, <https://www.indexmundi.com>
- İkiz, A. S. (2016) "Kamu ve Özel Kesim Sağlık Harcamaları ve İnsani Gelişme Endeksi İlişkisinin Türkiye için Analizi", Turkish Economic Association, Proceedings of 5th International Conference on Economics, 903-913, 20-22 October, Ankara-Turkey.
- Karataş, M. and Çankaya, E. (2011) "Türkiye'de Beşeri Sermaye ve Ekonomik Büyüme İlişkisinin Analizi", Celal Bayar Üniversitesi Yönetim ve Ekonomi Dergisi, 18 (1): 105-124.
- Kıymaz, H., Akbulut, Y. and Demir, A. (2006) "Tests of Stationarity and Cointegration of Health Care Expenditure and Gross Domestic Product", The European Journal of Health Economics, 7 (4): 285-289.
- Kızılkaya, O. and Koçak, E. (2014) "Kamu Eğitim Harcamaları ve Ekonomik Büyüme İlişkisi: Seçilmiş OECD Ülkeleri Üzerine Bir Panel Veri Analizi", Ekonomi Bilimleri Dergisi, 6 (1): 17-32.
- Lucas, R. E. (1988) "On the Mechanics of Economic Development", Journal of Monetary Economics, 22: 3-42.
- Opreana, A. and Mihaiu, D. M. (2011) "Correlation Analysis Between the Health System and Human Development Level Within the European Union", International Journal of Trade, Economics and Finance, 2 (2): 99-102.
- Pahlevi, M. (2017) "Impact of Governance and Government Expenditure on Human Development in Indonesia", Master of Arts in Development Studies, International Institute of Social Sciences, Netherlands, https://thesis.eur.nl/pub/41809/MMerita_MA_2016_17_GDP.pdf

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Pamuk, M. and Bektaş, H. (2014) "Türkiye'de Eğitim Harcamaları ve Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişki: ARDL Sınır Testi Yaklaşımı", *Siyaset, Ekonomi ve Yönetim Araştırmaları Dergisi*, 2 (2): 77-90

Prasetyo, A. D. and Zuhdi, U. (2013) "The Government Expenditure Efficiency Towards the Human Development", *Procedia Economics and Finance*, 5: 615-622.

Razmi, M. J., Abbasian, E. and Mohammadi, S. (2012) "Investigating the Effect of Government Health Expenditure on HDI in Iran", *Journal of Knowledge Management, Economics and Information Technology*, 5: 1-13, www.scientificpapers.org.

Selim, S., Uysal, D. and Eryiğit, P. (2014) "Türkiye'de Sağlık Harcamalarının Ekonomik Büyüme Üzerindeki Etkisinin Ekonometrik Analizi", *Niğde Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 7 (3): 13-24.

Sudirman, M. Z. MS (2017) "The Effect of Government Expenditures in Education and Health Against Human Development Index in Jambi Province", *The International Journal of Social Sciences and Humanities Invention*, 4 (8): 3823-3829.

Sülkü, S. N. and Caner, A. (2009) "Health Care Expenditures and Gross Domestic Product: The Turkish Case", Working Paper No: 09-03, TOBB University of Economics and Technology, Department of Economics, 1-18.

Taban, S. (2006) "Türkiye'de Sağlık ve Ekonomik Büyüme Arasındaki Nedensellik İlişkisi", *Sosyoekonomi*, 2: 31-46.

Tıraşoğlu, M. and Yıldırım, B. (2012) "Yapısal Kırılma Durumunda Sağlık Harcamaları ve Ekonomik Büyüme İlişkisi: Türkiye Üzerine Bir Uygulama", *Electronic Journal of Vocational Colleges*, 2 (2): 111-117.

Turkish Stats, www.tuik.gov.tr

Uçan, O. and Atay, S. (2016) "Türkiye'de Sağlık Harcamaları ve Büyüme Arasındaki İlişki Üzerine Bir İnceleme", *Niğde Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 9 (3): 215-222.

United Nations Development Programme (UNDP), Human Development Reports (HDR), <http://hdr.undp.org/en/composite/HDI>.

Ünalın, E. (2016) "Kamu Harcamaları ve İnsani Gelişme Arasındaki İlişki", Yüksek Lisans Tezi, Ankara Üniversitesi, SBE, Maliye Anabilim Dalı, <http://acikarsiv.ankara.edu.tr/browse/31879/tez.pdf>.

World Health Organization, <https://www.who.int/>.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Yalçın, A. Z. and Çakmak, F. (2016) “Türkiye’de Kamu Sağlık Harcamalarının İnsani Gelişim Üzerindeki Etkisi”, Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, 30 (4): 705-723.

Yardımcıoğlu, F. (2012) “OECD Ülkelerinde Sağlık ve Ekonomik Büyüme İlişkisinin Ekonometrik Bir İncelemesi”, Eskişehir Osmangazi Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 13 (2): 27-47.

Yılmaz, Z. and Danışoğlu, F. (2017) “Ekonomik Kalkınmada Beşeri Sermayenin Rolü ve Türkiye’de Beşeri Kalkınmanın Görünümü Olarak İnsani Gelişim Endeksi”, Dumlupınar Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi 51: 117-147.



GEÇİŞ EKONOMİLERİNDE MAKROEKONOMİK BELİRSİZLİK VE YATIRIM İLİŞKİSİ

Pelin ÖGE GÜNEY*

ÖZET

Ülkelerin ekonomik büyüme ve kalkınmalarında önemli bir role sahip olan yatırımlar, pek çok makro ekonomik ve mikro ekonomik değişkenden etkilendiği gibi makro ekonomik değişkenlerdeki belirsizlikten de etkilenmektedir. Belirsizliğin yatırımları nasıl etkilediği konusu ise literatürde tartışmalı bir konudur. Dolayısıyla konunun ampirik olarak araştırılması önem taşımaktadır. Bu çalışmada, seçilen geçiş ekonomileri için enflasyon, ekonomik büyüme ve döviz kuru belirsizliklerinin bu ülkelerin yatırımları üzerindeki etkisi analiz edilecektir. Öncelikle belirsizlik değişkenleri GARCH modeli ile elde edildikten sonra, değişkenler arasındaki uzun dönem ilişki Pesaran vd. (2001)'in geliştirdiği sınır testi yaklaşımı ile test edilmiştir. Son olarak, değişkenler arasındaki dinamik ilişkiyi görmek için hata düzeltme modeli tahmin edilmiştir. Çalışmamızın sonuçları, ele aldığımız ülkelerin bazıları için makro ekonomik değişkenlerdeki belirsizliğin yatırımları etkileyebileceğini ortaya koymaktadır. Bu sonuç, yatırımları artırarak ekonomik büyümeye katkı sağlamayı amaçlayan politikacılara yol gösterici olacaktır.

Anahtar Kelimeler: *Enflasyon Belirsizliği, Döviz Kuru, Yatırım, Sınır Testi, Geçiş Ekonomileri*

JEL Kodları: *E2, E6*

**MACROECONOMIC UNCERTAINTY AND INVESTMENT RELATIONSHIP FOR
SELECTED TRANSITION COUNTRIES**

ABSTRACT

Investments that have an important role in the economic growth and development of countries are affected by the uncertainty in macroeconomic variables as well as by many macroeconomic and microeconomic variables. The relationship between uncertainty and investments is a controversial issue in the literature. For example, price uncertainty may increase investments by increasing the expected profitability of capital. According to another view, in case of uncertainty, investors will have difficulty in making decisions and will prefer to postpone investments. Similarly, there is no consensus in the literature on the effects of uncertainty in inflation, economic growth and the the real exchange rates on investments. The increase in inflation uncertainty is considered as macroeconomic instability and increases the risk perception in the economy. This may lead to a decrease in investments (see Fischer and Modigliani (1978)). On the other hand, according to Dotsey and Sarte (2000), precautionary savings

* Doç.Dr., Hacettepe Üniversitesi İktisat Bölümü, Beytepe, Ankara, Türkiye, pelinoge@hacettepe.edu.tr

will increase in case of inflation uncertainty and investments will be affected positively. Therefore, empirical investigation of the subject is important. In this study, we investigate the effects of inflation, economic growth and exchange rate uncertainties on the investments for transition economies.

We use the GARCH model to measure the uncertainty variables and we investigated the long-term relationship of the variables using bound testing approach developed by Pesaran vd. (2001). Finally, in order to see the dynamic relationship between the variables, we adopt an error correction model. We obtain the variables from IMF- the International Financial Statistics, Penn World Table and World Development Indicators databases. Our results show that real exchange rate uncertainty reduces investment in two countries consistent with some earlier studies (e.g., Serven, 1998; Saman, 2010; Pradhan et al., 2004; Ghura and Grennes, 1993). We found that inflation uncertainty increases private investment in Romania. Our results will provide useful findings to policy makers aiming to improve investments to stimulate economic growth.

Keywords: Inflation Uncertainty, Exchange Rate, Investment, Bound Testing, Transition Countries.

JEL Codes: E2; E6.

1.GİRİŞ

Yatırımlar, yurt içi ve yurt dışı tasarrufların varlığı ve erişimi, finansal piyasaların gelişmişliği, faiz oranları, reel ücret düzeyi, vergiler gibi pek çok değişkenden etkilenmektedir. Bu faktörlerin yanı sıra, teorik çalışmalar, belirsizliğin özel kesim yatırımlarını etkileyen önemli bir değişken olduğunu ortaya koymaktadır (Abel, 1983; Pindyck ve Solimano, 1993; Caballero, 1991). Belirsizlik söz konusu olduğunda yatırımların geri döndürülemezliği (irreversibility) yatırım kararları üzerinde etkili olmaktadır. Belirsizlik durumunda bugün yatırımlarını artıran yatırımcı yarın belli bir maliyete katlanmadan ortadan kaldıramayacağı veya başka bir alanda kullanamayacağı bir sermaye fazlası ile karşılaşabilecektir (Bernanke 1983; McDonald ve Siegel 1986; Pindyck 1991). Bu durumda yatırımcılar karar almakta zorlanacaklar ve yeni bilgiler gelene kadar yatırımlarını ertelemeyi tercih edebileceklerdir. Diğer bir görüşe göre ise fiyat belirsizliği, sermayenin beklenen karlılığını artırarak yatırımları artırabilir. Benzer şekilde enflasyon belirsizliğinin yatırımlar üzerindeki etkisi konusunda da farklı yaklaşımlar vardır. Bir görüşe göre, enflasyon belirsizliğinin artması, makroekonomik istikrarsızlık olarak düşünülmekte ve ekonomide risk algısını artırmaktadır. Bu ise yatırımların azalmasına neden olabilmektedir (bkz. Fischer ve Modigliani (1978)). Diğer taraftan Dotsey and Sarte (2000)'e göre enflasyon belirsizliği durumunda ihtiyati tasarruflar artacak ve yatırımlar bundan olumlu etkilenebilecektir.

Döviz kurlarındaki belirsizlik de yatırım kararlarında etkilidir. Öncelikle kur belirsizliği, firmaların ihracat piyasasına girmelerini engelleyebilecektir. Bu sektörlere girmenin görelî avantajını tahmin etmek, yeni yatırımların maliyetini hesaplamak zorlaşacaktır. Darby vd. (1999) reel döviz

kurundaki belirsizliğin yatırımları olumsuz etkilediğini ileri sürmüşlerdir. Tornell (1989) ise faiz oranlarındaki belirsizliğin optimal yatırım zamanı kararını etkileyebileceğini ileri sürmüştür. Buna göre, faiz oranındaki değişkenliğin yatırımlar üzerindeki etkisi, faiz oranının etkisinden daha fazla olabilecektir. Diğer taraftan, büyüme oranlarındaki belirsizlik, talebi tahmin etmeyi zorlaştırmaktadır ve Bertola (1989) talepteki artan belirsizliğin genelde yatırımlarda azalmaya yolaçtığını göstermiştir.

Yatırımların makro ekonomik değişkenlerdeki belirsizlikten nasıl etkilendiği konusunda sınırlı bir ampirik çalışma literatürde mevcuttur ve genelde gelişmiş ülke ekonomileri ele alınmıştır. Bu çalışmada ise literatürde üzerinde fazla çalışma yapılmamış olan ve kendine özgü nitelikleri olan geçiş ekonomileri ele alınmaktadır. Seçilen geçiş ülkelerinde enflasyon, reel döviz kuru ve büyüme belirsizliğinin bu ülkelerdeki özel yatırımlara etkisini analiz etmek amaçlanmaktadır.

Geçiş ülkeleri 1980'lerin sonlarında ve 1990'ların başlarında reformlar gerçekleştirmiş ve bu reformlarla, merkezi olarak planlanmış ekonomilerini piyasa ekonomisine dönüştürmeyi amaçlamışlardır. Bu dönüşümlerden önce, merkezi otorite yatırım kararlarını almaktadır ve fiyatların kaynak tahsisinde bir rolü yoktur. Ayrıca, finansal kurumlar gelişmemiş ve faiz oranları yatırım kararlarında rol oynamamıştır. Geçiş sürecinde bu ülkelerde fiyatlar, ticaret ve döviz piyasası serbestleşmiş ve piyasa kurumları oluşturulmuştur. Bu ülkelerin çoğu, Dünya Ticaret Örgütü, Ekonomik İşbirliği ve Kalkınma Örgütü (OECD) ve Avrupa Birliği (AB) gibi bazı uluslararası politika ve ekonomi örgütlerine üye olmuştur. Yukarıdaki gelişmelere paralel olarak geçiş ülkelerinin yatırım ortamı iyileşmiştir. Yeni sistemde, fiyatlar, sermayenin gerçek maliyetini belirlemek için bilgilendirici bir rol oynamaktadır. Geçiş sürecinin ilk on yılında, bu ülkeler yüksek enflasyon ve durgunluk yaşamışlardır. 2000'li yıllardan başlayarak ise yüksek büyüme oranlarına sahip olmuşlardır. Geçiş ülkelerinin politika önceliklerinden biri makroekonomik ve finansal istikrardır. Bu çalışmada yatırımlar için bu politika önceliğinin önemini analiz etmek amaçlanmaktadır. Literatürde geçiş ekonomileri üzerine nispeten daha az araştırma olduğu görülmektedir. Bu bağlamda, bu çalışma seçilen geçiş ülkeleri için teorik olarak belirsiz olan belirsizlik-yatırım ilişkisini analiz ederek literatüre katkıda bulunmayı amaçlamaktadır. Bu ilişki, ülkelerin farklı makroekonomik durumları ve politikaları nedeniyle farklılık gösterebileceğinden, her bir ülke ayrı ayrı ele alınmıştır. Elde edilen sonuçların, hükümetlerin yatırım üzerindeki olumsuz etkileri en aza indirecek politikalar tasarlamalarına yardımcı olacağı düşünülmektedir.

2. VERİLER VE BELİRSİZLİK DEĞİŞKENİNİN ELDE EDİLMESİ

Çalışmada çeyrek dönmelik veriler kullanılmıştır. Tablo 2'de verilerin kapsadığı dönem görülmektedir ve verilerin ulaşılabilirliğine göre bu tarihler belirlenmiştir. Çalışmada kullanılan özel kesim yatırımları, reel faiz oranı, döviz kuru, faiz oranı, enflasyon, GSYH verileri Uluslararası Para Fonu-Uluslararası Finansal İstatistikler veri tabanından elde edilmiştir. Sermayenin kullanım maliyetinin bir göstergesi olan sermayenin görelî fiyatı verisi Penn Dünya Tablosu veri tabanından ve

kredi piyasasının sıklığının bir göstergesi olan özel kesime açılan krediler verisi ise Dünya Kalkınma Göstergeleri veri tabanından elde edilmiştir.

Belirsizlik değişkenlerini elde etmek için aşağıdaki Genelleştirilmiş Otoresif Koşullu Değişen Varyans (GARCH) yöntemi kullanılmış ve GARCH modelindeki hata teriminin varyansı belirsizlik değişkeni olarak alınmıştır.

$$y_t = \beta_0 + \sum_{j=1}^q \beta_j y_{t-j} + \varepsilon_t \quad (1)$$

$$h_t^2 = \alpha_0 + \alpha_1 \varepsilon_{t-1}^2 + \alpha_2 h_{t-1}^2 \quad (2)$$

y_t belirsizliğini bulmak istediğimiz değişken, ε_t ortalaması sıfır olan hata terimi ve h_t koşullu varyans terimidir. Akaike Bilgi Kriterine göre uygun model seçilmiştir.

3. AMPİRİK BULGULAR

Öncelikle verilerin durağanlıkları analiz edilmiş ve sonuçlar Tablo 1'de verilmiştir. Buna göre kullanılan verilerin bir kısmı birim kök içerirken bir kısmı durağandır.

Tablo 1. Birim Kök Test Sonuçları

| | Hırvatistan | Çekya | Estonya | Macaristan | Letonya | Litvanya | Romanya |
|------------|-------------|----------|----------|------------|---------|----------|---------|
| I | -1.236 | -2.167 | -3.022 | -2.128 | -2.157 | -2.401 | -2.162 |
| i | -3.611** | -3.536** | -3.367** | -4.208* | -4.431* | -2.408 | -2.570 |
| y | -0.532 | | | | -1.791 | | -3.090 |
| cp | -1.679 | -0.424 | -2.165 | -1.854 | -1.901 | -1.662 | -1.693 |
| cr | -0.232 | -2.255 | -2.100 | -3.798** | -2.320 | 1.467 | -1.024 |
| EX_bls | -4.860* | -2.524 | -4.999* | -1.101 | -2.815 | -2.209 | -5.044* |
| π _bls | -4.750* | -2.626 | -0.317 | -5.460* | -2.772 | -7.267* | -2.430 |
| GRW_bls | -5.899* | -2.382 | -6.864* | -7.874* | -5.555 | -1.688 | -5.108* |

Not: *, ** ve *** sırası ile 1%, 5% ve 10% düzeyinde anlamlılığı ifade etmektedir.

Bu durumda seriler arasında uzun dönem eş-bütünleşme olup olmadığını analiz etmek için serilerin durağan olup olmamasına bağlı olmayan ve Pesaran vd. (2001) tarafından geliştirilen sınır testi yaklaşımı kullanılmıştır. Aşağıdaki eşitlik tüm belirsizlikler ve ülkeler için tahmin edilmiştir.

$$\Delta I_t = \beta_0 + \beta_1 I_{t-1} + \beta_2 i_{t-1} + \beta_3 y_{t-1} + \beta_4 cp_{t-1} + \beta_5 cr_{t-1} + \beta_6 bls_{t-1} + \sum_{i=1}^n \beta_7 \Delta I_{t-i} + \sum_{i=0}^n \beta_8 \Delta i_{t-i} + \sum_{i=0}^n \beta_9 \Delta y_{t-i} + \sum_{i=0}^n \beta_{10} \Delta cp_{t-i} + \sum_{i=0}^n \beta_{11} \Delta cr_{t-i} + \sum_{i=0}^n \beta_{12} \Delta bls_{t-i} + \gamma_t \quad (3)$$

Tablo 2’de sınır testi sonuçları verilmektedir. Çekya ve Estonya dışında F testleri değişkenler arasında eş bütünleşme olduğuna işaret etmektedir. Aralarında eş bütünleşme bulunan modeller için dinamik ilişkiyi analiz etmek için hata düzeltme modeli tahmin edilmiştir.

Tablo 2. Uzun Dönem İlişki Testi F-İstatistikleri

| | Hırvatistan | Çekya | Estonya | Macaristan | Letonya | Litvanya | Romanya |
|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| Zaman Periyodu | 2000Q1-2016Q4 | 1997Q4-2016Q4 | 2000Q3-2009Q4 | 1997Q4-2016Q3 | 1997Q1-2013Q4 | 2000Q3-2014Q4 | 1999Q3-2014Q4 |
| USD_bls | F=4.225** | F=2.147 | F=1.716 | F=4.202** | F=5.591* | F=4.931* | F=4.127** |
| İnf_bls | F=3.425*** | F=1.382 | F=1.757 | F=4.684* | F=4.331** | F=6.961* | F=7.513* |
| Grow_bls | F=4.698* | F=1.529 | F=2.670 | F=4.724* | F=4.564* | F=5.667* | F=5.678* |

Not: *, ** ve *** sırası ile 1%, 5% ve 10% düzeyinde anlamlılığı ifade etmektedir. F değerleri, Pesaran, Shin ve Smith (2001)’de Tablo CI(iii) III. durumda yer alan kritik değerler ile karşılaştırılmıştır. Gecikme sayısı Akaike Bilgi Kriterine göre seçilmiştir.

Aşağıdaki hata düzeltme modelinde EC terimi modeldeki tüm bağımlı ve bağımsız değişkenlerin düzeyde regresyonundan elde edilmiştir.

$$\Delta I = b_0 + b_1 \Delta I_{t-1} + b_2 \Delta i + b_3 \Delta y + b_4 \Delta y_{t-1} + b_5 \Delta cp + b_6 \Delta cr + b_7 \Delta bls_i + b_8 EC_i + v_2 \quad (4)$$

Değişkenler arasındaki kısa dönem ilişkiyi gösteren hata düzeltme modelinin tahmin sonuçları Tablo 3’de verilmektedir. Tüm tahminlerde hata düzeltme terimi negatif ve anlamlıdır. Çalışmamızın odak noktasını oluşturan belirsizlik katsayılarına bakarsak, Hırvatistan ve Macaristan için döviz kurundaki belirsizliğin bu ülkelerde yatırımları olumsuz etkilediği görülmektedir. Diğer ülkelerde de döviz kuru belirsizliği katsayısı negatif bulunmakla birlikte istatistiksel olarak anlamsızdır. Ancak Romanya için bu katsayı ilginç bir şekilde pozitif ve anlamlıdır. Enflasyon belirsizliğine bakarsak sadece Romanya için bu katsayı anlamlıdır. Romanya’da artan enflasyon belirsizliğinin yatırımları artırdığı görülmektedir. Büyüme belirsizliği katsayısı ise Macaristan’da negatif ve anlamlı bulunmuştur. Dolayısıyla bu ülkede büyüme belirsizliği yatırımları azaltmaktadır.

Tablo 3. Hata Düzeltme Modeli Tahmini

| | Hırvatistan | | | Macaristan | | |
|--------------------|-------------|----------|----------|------------|----------|-----------|
| Sabit | -0.003 | -0.003 | -0.003 | -0.001 | -0.001 | -0.001 |
| ΔI_{t-1} | 0.254*** | 0.262*** | 0.292** | 0.356*** | 0.516** | 0.480** |
| Δi | 0.420*** | 0.324 | 0.399 | -0.042 | -0.015 | 0.182 |
| Δy | -0.292 | -0.589 | -0.565 | -0.033 | -0.019 | -0.044 |
| Δy_{t-1} | 3.338* | 3.675* | 3.721* | -0.036 | -0.019 | -0.060 |
| ΔCP | 0.105 | 0.084 | 0.119 | 0.310*** | 0.250 | 0.237 |
| ΔCR | -0.002 | -0.002 | -0.003 | 0.002 | 0.002 | 0.002 |
| ΔEX_{bls} | -1.089** | | | -0.507*** | | |
| EC_1 | -1.138* | | | -1.075* | | |
| $\Delta \pi_{bls}$ | | 0.025 | | | 0.017 | |
| EC_2 | | -1.116* | | | -1.139* | |
| ΔGRW_{bls} | | | -0.001 | | | -0.004*** |
| EC_3 | | | -1.117* | | | -1.102* |
| | Letonya | | | Litvanya | | |
| Sabit | -0.001 | -0.001 | -0.002 | -0.002 | -0.001 | -0.001 |
| ΔI_{t-1} | 0.852* | 0.899* | 0.796* | 0.820* | 0.806* | 0.830* |
| Δi | -0.033 | -0.017 | -0.009 | 1.830* | 1.623* | 2.142* |
| Δy | 1.714** | 1.800** | 1.912 | 0.548* | 0.578* | 0.497** |
| Δy_{t-1} | - | -1.969** | - | -0.442 | - | -0.455*** |
| | 1.766*** | | 1.736*** | | 0.493*** | |
| ΔCP | 0.001 | 0.103 | 0.071 | 0.883** | 0.900** | 0.999* |
| ΔCR | 0.001 | 0.001 | 0.001 | 0.001 | 0.001 | 0.001 |
| ΔEX_{bls} | -0.307 | | | -1.262 | | |
| EC_1 | -1.104* | | | -1.110* | | |
| $\Delta \pi_{bls}$ | | 0.012 | | | -0.021 | |
| EC_2 | | -1.159* | | | -1.094* | |
| ΔGRW_{bls} | | | -0.002 | | | -0.011 |
| EC_3 | | | -1.048* | | | -1.161* |
| | Romanya | | | | | |
| Sabit | -0.003 | -0.002 | -0.002 | | | |
| ΔI_{t-1} | 0.516* | 0.476* | 0.534* | | | |
| Δi | 0.156 | 0.178 | 0.181 | | | |
| Δy | 1.406* | 1.277* | 0.918*** | | | |
| Δy_{t-1} | -1.135** | -1.014** | -0.975** | | | |
| ΔCP | 0.072 | 0.105 | 0.107 | | | |
| ΔCR | 0.004*** | 0.004*** | 0.005** | | | |
| ΔEX_{bls} | 0.346** | | | | | |
| EC_1 | -1.115* | | | | | |
| $\Delta \pi_{bls}$ | | - | | | | |
| | | 0.022*** | | | | |
| EC_2 | | -1.244* | | | | |
| ΔGRW_{bls} | | | 0.066 | | | |
| EC_3 | | | -1.175* | | | |

Not: *, ** ve *** sırası ile 1%, 5% ve 10% düzeyinde anlamlılığı ifade etmektedir.

4. SONUÇ

Çalışmamızın sonuçlarına göre analiz ettiğimiz yedi geçiş ekonomisinin iki tanesinde reel döviz kurundaki belirsizlik önceki çalışmalarla tutarlı şekilde (örn, Serven, 1998; Saman, 2010; Pradhan vd., 2004; Ghura ve Grennes, 1993) yatırımları azaltmaktadır. Diğer taraftan Romanya'da enflasyon belirsizliğinin özel kesim yatırımlarını azalttığı saptanmıştır. Macaristan için ise büyüme belirsizliğini

yatırımları olumsuz yönde etkilediği görülmüştür. Dolayısıyla sonuçlarımız, geçiş ekonomilerinde makro ekonomik değişkenlerdeki belirsizliğin yatırımları etkileyebileceğini ortaya koymaktadır. Bu sonuç, yatırımları artırarak ekonomik büyümeye katkı sağlamayı amaçlayan politikacılara yol gösterici olacaktır.

KAYNAKÇA

- Abel, A. B. (1983) “Optimal Investment Under Uncertainty”, *American Economic Review*, 73: 228–33.
- Bernanke, B. S. (1983) “Irreversibility, Uncertainty, and Cyclical Investment”, *The Quarterly Journal of Economics*, 98(1): 85-106.
- Bertola, G. (1998) “Irreversible Investment”, *Research in Economics*, 52(1): 3-37.
- Caballero, Ricardo J. (1991) “On the Sign of the Investment-Uncertainty Relationship”, *American Economic Review*, 81(1): 279-88.
- Darby, J., Hallett, A.H., Ireland, J. and Piscitelli, L. (1999) “The Impact of Exchange Rate Uncertainty on the level of Investment”. *Economic Journal*, 109: 55-67.
- Dotsey, M., Sarte, P.D. (2000) “Inflation Uncertainty and Growth in a Cash-in-Advance Economy”, *Journal of Monetary Economics*, 45(3): 631-655.
- Fisher, S. M. F. (1978) “Towards an Understanding of the Real Effects and Costs of Inflation”, *Weltwirtschaftliches Archiv*, 114: 810.
- Ghura, D. and Grennes, T.J. (1993) “The Real Exchange Rate and Macroeconomic Performance in Sub-Saharan Africa”. *Journal of Development Economics*, 42(1): 155-174.
- McDonald, R., Siegel, D. (1986) “The Value of Waiting to Invest. *Quarterly Journal of Economics*”, 101(4): 707-727.
- Pesaran, M. H., Shin, Y. and Smith, R.J. (2001) “Bounds Testing Approaches to the Analysis of Level Relationships”. *Journal of Applied Econometrics*, 16(3): 289-326.
- Pindyck, R.S. (1991) “Irreversibility, Uncertainty, and Investment”, *Journal of Economic Literature*, 29(3): 1110–1148.
- Pindyck, R. S. and Solimano, A. (1993) “Economic Instability and Aggregate Investment” *NBER Macroeconomics Annual* No: 8.
- Pradhan, G., Schuster, Z. and Upadhyaya, K.P. (2004) “Exchange Rate Uncertainty and the Level of Investment in Selected South-East Asian Countries”, *Applied Economics*, 36: 2161-2165.
- Saman, C. (2010) “Macroeconomic Uncertainty and Investment: Empirical Analysis for Romania”

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Romanian Journal of Economic Forecasting, 2/2010: 155-164.

Serven, L. (1998) “Macroeconomic Uncertainty and Private Investment in Idcs: An Empirical Investigation”, World Bank Policy Research Working Paper No: 2035.

Tornell, A. (1989) “Real vs. Financial Investment: Towards an Explanation of Short-Termism”, Columbia University, Department of Economics, New York. Processed.



ENTREPRENEURSHIP DEVELOPMENT AND POVERTY INCIDENCE AMONG FEMALE PARTICIPANTS IN SMALL SCALE ENTERPRISES IN LAGOS STATE, NIGERIA

Akande OLUSOLA*

Mutiat JAMES**

Abimbola OLADOTUN***

ABSTRACT

This research primarily focused on the effect of female participation in small and medium scale enterprises on poverty status of women households in Lagos State. Multistage sampling technique was employed to collect data from 114 respondents comprising 56 Micro and Small and Medium Scale Enterprises (MSMEs) participants and 58 non-participants in the study area. Data were analysed using descriptive statistics, Foster, Greer and Thorbecke's (FGT) weighted poverty index and the Probit Regression analysis. The study revealed that the sampled non-participants female households had higher poverty incidence (60%) while the SME participants' poverty incidence was less than 15%. Also, the result showed that the non-participants contributed heavily to the poverty of the whole group and that MSMEs' participants benefited directly from government entrepreneurship programmes whereas the non-participants did not enjoy any direct benefit. The estimated regression analysis revealed that educational status, participation in MSMEs, access to microfinance credit, household income, and monogamous household type are factors that reduce poverty status of households. It was concluded with policy recommendations that government should promote more female entrepreneurship development as a remedy to escape from rural household poverty in the rural area of Lagos state.

Keywords: *Entrepreneurship, Government Assistance, Micro Small and Medium Scale Industries and Poverty Incidence.*

1.INTRODUCTION

Women are regarded as the world's poor because the majority of the 1.5 billion people living on 1dollar a day or less are women and earn an average slightly more than 50 percent of what men earn (UNDP, 2000). Women poverty is understood in different ways such as a situation of deprivation, inability to measure up to certain expectations related to basic needs and inability to create resources for

* Department of Management and Accounting, Faculty of Management Science LadokeAkintola University of Technology Ogbomosho Nigeria,

** Department of Business Administration Lagos State Polytechnic, Ikorodu, Lagos, Nigeria,

*** Department of Business Administration Lagos State Polytechnic, Ikorodu, Lagos, Nigeria, Email:

1sola2much4u@yahoo.com, 2jamesmutiat@yahoo.com, +2348056118346, 3richestmine@yahoo.com +2349038807587

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

recreation and holidays. Also, Nigerian women are affected with poverty and have long duration in poverty because they often have too many children spaced too close together to the detriment of their health and productivity (Ijaiya, 2000). The incidence of poverty among Nigerian women has been progressively increasing. It has increased from 26.9% in 1980 to 58.5% in 1996 and in the past two decades women have constantly been put under the pressure of retrenchment, belt tightening fiscal policies to boost the deteriorating economic activities more than men and has forced them to share the preserved role of the provider with men or in some cases assume the entire responsibility (Adejobi, 2004). The core source of the entire gender differential in poverty is that women relative to men are more vulnerable because of the socio-cultural framework of human society. The socio-cultural beliefs are the limiting factors, which limit the opportunities and capabilities of women, and make them resource less and powerless individuals (Ijaiya, 2000). Nigerian women constitute more than 50% of the Nigerian population and out of this; only about 35% of them are involved in entrepreneurship which can be under the form of micro, small, medium and large enterprises (Odoemene, 2003).

According to Kirkwood (2009), women own nearly 30% of all businesses, 50% of all retail businesses, and 10% of all service companies. However, these statistics still indicate a relatively lower entrepreneurship rate amongst the female working population. Some socio-economic deprivations have been identified as reasons for low women entrepreneurs and that many women lack experiences, either personal or vicarious, related to successful accomplishment of entrepreneurial tasks. Most entrepreneurial women had to make choices about child-bearing, child-raising and running a household (Noble, 2006). They must also assume the role of mother and family/household caregiver, which limits the time and energy that they have to give to their businesses (Stevenson, 2006). Buttner (2003) enumerated factors that affected women's entrepreneurial success to include, entrepreneurial experience (such as the number of previous ventures involvements), quality of products/services and the women's determination to succeed, communication skills, market opportunity, financial management skills, idea generation and motivation. High energy levels, skill in influencing others ambition, self-esteem, competitiveness, achievement, willingness to assume risk, support and understanding of family members, especially the spouse; length of time in business and developing network contacts are added factors for entrepreneurial success (Woodward, 2008). Nigerian women entrepreneurs are deprived of most of these qualities.

Consequently, this research will provide answer to the following thought provoking research questions:

What are the determinants of poverty among female households in the state?

Are there any government incentive programmes towards female entrepreneurship development in the state?

Does women participation in Small scale industries influence their poverty status?

Research Objectives: The main objective of this study is to determine the effect of women participation in micro and small scale enterprises on poverty status of women households in Lagos State. Specifically, it determined effect of government incentives on poverty status of the female SMEs participants in Lagos state of Nigeria.

Research Hypothesis:

H₀: Female participation in Micro and Small Scale Enterprises does not significantly affect poverty status of women in Lagos State.

H₁: Female participation in Micro and Small Scale Enterprises significantly affects poverty status of women in Lagos State.

2.LITERATURE REVIEW

2.1. Theoretical and Conceptual Frameworks

This study shall be guided by Schumpeterian Theory of Entrepreneurship, Vroom theory of expectancy, Poverty theories and Development Theory of Poverty Reduction.

2.1.1 Schumpeterian Theory of Entrepreneurship

Joseph Alois Schumpeter's theory of entrepreneurship began in 1911. He avers that the entrepreneur is able to break the static equilibrium of traditional societies characterised by circular stagnation through carrying out new combinations of activities referred to as innovations. Thus innovations consist of the introduction of new products, the introduction of new method of production, the opening of a new market, the conquest of a new source of supply of raw materials or semi-manufactured goods and carrying out of a new organisation of any industry (Olu-Aderounmu, *et al.* 2012). According to Schumpeter(1934), since economic progress comes from innovations, the innovator who is a monopolist at this point in beginning a new idea should be protected from exploitation by people who would take over his/her ideas by imitation and produce counterfeit products to sell at lower prices hence knocking him/her out of business.

Schumpeter assigns the role of innovation to the entrepreneur who is motivated by (a) the desire to establish a private commercial kingdom; (b) the atavistic will to conquer and prove his superiority; and (c) the job of creating, of exercising one's energy and ingenuity. Schumpeter's innovation represents not only the first dynamic concept of the entrepreneurial function, but he was the first major writer to put the human agent at the centre of the process of economic development. Schumpeter's theory of entrepreneurship is relevant to the study because the woman entrepreneur in Lagos will take advantage

of the market conditions and the environment to come up with new ideas, creativity and innovation to make new products. The products created will then be sold to the society and customers to create wealth and profits hence economic development.

2.1.2 Vroom Theory of Expectancy

In his theory of expectancy, Vroom (1964) proposed that a person's behaviour is motivated by the expectation that her behaviour will lead to certain outcomes, together with the values she places on those outcomes. He based his theory on the notion that behaviour is a function of interaction of personality and the environment. Vroom's theory built on the concepts of valence, instrumentality and expectancy. Applying this to women entrepreneurs, it is expected that the level at which women will engage in entrepreneurial innovative behaviour is dependent on how well they desire growth (valence), their perceived probability that their efforts will lead to achievement of their goal (their enterprise growth) and that their innovativeness will have a positive effect on their enterprise.

2.1.3 Development Theory of Poverty Reduction

Development Theory of Poverty Reduction holds that most countries progress through similar stages of development in an effort to curb poverty (Potterovich, & Popov, n.d.). There are four stages of development. Stage one, which is the pre-industrial stage is characterized by high death and birth rates but not much of economic development. The country begins to develop in stage two where the death rates decline and there is improved food supply and proper sanitation. Birth rates begin to fall in stage three because people are now able to practice family planning. There is also urban development, increase in education, and parents begin to invest. This has made it possible for developed countries to assist the underdeveloped countries so as to free them from persistence donor dependence. Stage four is characterized by low birth and death rates. There is increased development at this stage.

This study submits that the development stage theory is equated to the stages the woman entrepreneur undergoes in her business in an effort to reduce poverty. The woman begins her business from a low level of selling a few items by hawking, which require minimal capital. She eventually gets to sell in a counter, eventually progressing to sell in shops or wholesale market and exporting the products. The woman entrepreneur can be assisted through various methods to reduce poverty such as availing credit facilities for business, investment opportunities, creating markets for their products, use of modern technology and offering vocational and technical training. It is for this reason that the government will support the women projects to develop entrepreneurial activities that will assist in poverty reduction.

2.1.4 Concept of Entrepreneurship

According to Drucker (1985), entrepreneurship is a perceptiveness to change and the entrepreneur as one, who always searches for change, responds to and exploits it as an opportunity. Drucker notes that entrepreneurship is practice behaviour. It is a discipline and like any discipline, it can be learned. Kuratko and Hodgetts (2004) noted that in the simplest of theoretical forms of studying entrepreneurship, entrepreneurs cause entrepreneurship. That is, $E=F(e)$ states that entrepreneurship (E) is a function of entrepreneur (e).

Entrepreneur is a highly respected person in the developed world. Entrepreneur may be either an individual or a group who is involved in the assemblage of factors of production for the purpose of generating output and with the ultimate aim of earning a profit (Aderounmu, *et al*, 2012); both are equally significant in the development of less developed countries. The word entrepreneurship conjures up visions of active, purposeful men and women accomplishing significant achievements. The entrepreneurs are important agents of change in every society, yet they present the most enigmatic characters in the drama of economic development, particularly in the less developed world. Although it is an entrepreneur's purposive activity that bridges the gap between plan and reality, the precise way that this agent of change acts is often unpredictable. According to Olu-Aderounmu, *et al*. (2012), the principal entrepreneurial role in less developed nations (including Nigeria) is the ability to acquire, adapt and modify the existing large stock of proven technical innovations already available in the advanced countries of the world. They are people who recognize the strengths, weaknesses, opportunities and threats of their enterprise and build opportunity for its success.

2.1.5 Concept of Poverty

Sumner (2003) defined poverty as the inability to fulfil the basic requirements to attain a decent life and therefore obtain adequate nutrition, housing and clothing. Salami, (2013) defined poverty as lack of access to resources, concern for human rights and environmental challenges; and exposure to violence, injustice, powerlessness and uncertainty in the face of unexpected situations like sicknesses, accidents and natural disasters. Asikhia (2010) defined poverty as the condition that limits individual's ability to provide for himself and his loved ones, noting that this condition manifests in the lack of food, clothing, shelter, etc. This implies that poverty is largely a state of deprivation, lacking and denial of basic necessities of life. Majority of people in Nigeria are poor and unable to satisfy these basic necessities of life. As opined by Sachs, (2005), it is useful to distinguish between three degrees of poverty: extreme (or absolute) poverty, moderate poverty, and relative poverty. Extreme poverty means that households cannot meet basic needs for survival. They are chronically hungry; unable to access healthcare, lack the amenities of safe drinking water and sanitation, cannot afford education for some or all of the children, and perhaps lacks rudimentary shelter and basic articles of clothing. He further

expands that unlike moderate and relative poverty, extreme poverty occurs only in the developing world. Moderate poverty he defines as generally construed as a household income level below a given proportion of national income. The relatively poor, in high income countries, lack access to cultural goods, entertainment, and recreation and to quality healthcare, education and other prerequisites for upward social mobility. Thus, while an individual may have more than enough income to sustain life, if it is very low compared to the rest of the community, the individual may be viewed as being in poverty. As the society grows richer, so the income level defining poverty rises. One may see poverty from the angle of permanence and transience. In the opinion of Aliyu (2003), several types of poverty may be distinguished depending on such factors as time or duration. If the poverty is widespread, the occurrence itself is of limited duration and distribution. If it involves relatively permanent insufficiency of means to secure basic needs, the condition may be so general as to describe the average level of life in the society or it may be concentrated in relatively large groups in an otherwise prosperous society.

2.2. Empirical Literature Review on Female Entrepreneurship and Poverty

When Misango and Ongiti (2013) examined the economic role of women entrepreneurs in poverty reduction in Kenya using the case of women entrepreneurs at the Maasai market within Nairobi City's Central Business District. From the target population of 664, 15% were sampled for the study, through stratified and purposive sampling techniques. Quantitative and qualitative data were collected by use of questionnaires and interviews, hence analyzed concurrently. The study showed that the economic activities carried out by the respondents were similar in nature and included selling of African artefacts, clothing and ornaments. Most respondents (95%) used readily available raw materials to make their products for sale. The study also revealed that majority of the respondents (83%) agreed that the businesses had made them improve their economic status. The businesses contributed to the promotion of tourism, employment and export trade. The study concludes that women entrepreneurs play a major role in poverty reduction in Kenya.

Fajimi and Omonona (2011) examined the impact of women participation in agro-allied small and medium scale enterprises (SMEs) on poverty alleviation in Oyo State, Nigeria. Data were collected using the multistage sampling technique from 119 respondents in the study area made up of 59 participants and 60 non-participants. Data generated were analysed using descriptive statistics, FGT – weighted poverty measures and Probit regression analysis. Results from the study showed that the non-participants have the highest poverty level (51%), while the participants have poverty level of (17%) and the non-participants contribute greatly to whole group poverty. The estimated probit regression analysis showed that marital status, household size and women status in the family are poverty enhancing while educational status, participation in Small and Medium Enterprises, income and monogamous family type are poverty reducing. Hence participation in agro-allied Small and Medium Enterprises is antidote to reducing poverty among women. However, neither of the studies identified

any government programmes and incentives to encourage women entrepreneurs' development. This research proposes to investigate government entrepreneurship development programmes among women entrepreneurs' in Lagos State, Nigeria.

Adofu and Ocheja (2013) assessed the impact of entrepreneurship skill acquisition on poverty in Kogi State of Nigeria. The study made use of primary data collected with the aid of a well-structured questionnaire which were administered by well-trained enumerator to beneficiaries of entrepreneurship acquisition skills randomly sampled from six Local Government Area of the state. The data collected through the questionnaire was analysed using descriptive statistics like frequencies and percentages. The result shows that 65% of the respondents accepted that lack of entrepreneurship skills among youth is responsible for the high rate of poverty in Nigeria. The result also revealed that at least 60% of the people that benefitted from the skill acquisition programme can now afford the basic necessity of life. The study therefore recommended that since most of the people that benefitted from the programme could afford the basic necessity of life, the government should begin to think of the way of developing the programme to the status of poverty eradication programme. While this study recommended involvement of government in poverty eradication in the study area, the study never measured impact of any government existing programme or incentive on poverty eradication in the state. However, the current research work shall identify and evaluate various poverty reduction programmes in Lagos state.

3. RESEARCH METHODOLOGY

The study was conducted in Lagos State of Nigeria. Lagos State is located in the South West region of Nigeria and lies between latitude $6^{\circ} 27' 11''$ North of the equator and between longitude $3^{\circ} 23' 45''$ East of the prime meridian. The state is made up of 20 Local Government Areas (LGA). Three LGAs were chosen for the study.

3.1. Sampling Procedure

Multistage sampling technique was employed for selecting the female households in the study. The first stage was purposive selection of three local government areas from the Lagos West zone of the state. The second stage was sampling of six towns from the selected three LGAs. The third stage involved the use of systematic random sampling to obtain the required SMEs participants and non-participants by selecting every tenth housing unit/in which four women were randomly selected for interview. The research instruments were duly validated and pilot-tested for reliability before field questionnaire administration by trained data collectors and the researchers. A total of 150 female households consisting of 75 SMEs owners and 75 non SMEs owners were sampled. However, out of the 120 retrieved questionnaires, only 114 questionnaires were correctly completed and used for the research analysis.

3.2. Formula for Calculating Contribution to Poverty P_0 , P_1 and P_2

The contribution (K) of each sub-group's weighted poverty measure to the whole group's weighted poverty measure will be obtained by using

$$K = n_i P_{ai} / n P_a \quad (2)$$

The correlates of poverty will be isolated using a Probit model in which a dichotomous variable representing whether or not a household is poor will be regressed on a set of independent variables.

The Probit regression model hypothesizing the determinants of poverty and ascertaining the effects of certain factors (especially SME participation among women) is stated below as:

$$Y = \beta_0 + \sum \beta_1 X_t \quad (3)$$

The dependent variable Y is of a binary nature (poverty status of women), which takes 1 and 0: 1 if poor, 0 if non-poor. The independent variables (X) are as follows:

X_1 - Age of the respondents (in years)

X_2 - Marital status (Dummy D = 1, if married, 0 if otherwise)

X_3 - Household type (Dummy, D = 1 if monogamous, 0 if otherwise)

X_4 - Household size

X_5 - Educational status (Number of years spent in school)

X_6 - Women status in family (Dummy, D = 1 if household head, 0 if otherwise)

X_7 - Participation Dummy (D = 1 if participant, 0 if non-participation).

X_8 - Income (Naira)

X_9 - Dependency Ratio

X_{10} - Type of family (monogamy or polygamy)

X_{11} - Cooperative society

X_{12} - Government assistance

X_{13} - Micro-finance bank access

4.FINDINGS AND DISCUSSION

Table 1. Socio Economic Characteristics of the Respondents

| Variables | Participants | Non-Participants |
|---------------------------------|--------------|------------------|
| Age of women (mean in years) | 46.76 | 35.94 |
| Marital Status (%married) | 67 | 77 |
| Educational status (mean) | 7.9 | 8.2 |
| Household size (mean) | 5.6 | 5.5 |
| Dependency ratio (mean) | 6 | 4 |
| Household type (% polygamous) | 61 | 49 |
| Women status (% household head) | 49 | 23 |
| Income (mean monthly in Naira) | 19,121 | 8,430 |

Source: Field Survey, 2017

Table 2. Female Household Expenditure and Poverty Status

| Participants Index | Poverty Estimate | | | Contribution to Poverty | | |
|--------------------|------------------|----------------|----------------|-------------------------|----------------|----------------|
| | P ₀ | P ₁ | P ₂ | P ₀ | P ₁ | P ₂ |
| MSMEs Participants | 0.148 | 0.062 | 0.002 | 0.292 | 0.143 | 0.072 |
| Non-Participants | 0.602 | 0.232 | 0.042 | 0.708 | 0.857 | 0.928 |
| All Households | 0.417 | 0.560 | 0.021 | 1.000 | 1.000 | 1.000 |

Source: Composed from Field survey data, 2017

4.1. Socio Economic Characteristics of the Sampled Female Households

The socio economic characteristics of the female households in Lagos State such as age, marital status, educational status, household size, household type, women status and income level are discussed in this section. As shown in Table 1 below, the average age of the sampled micro and small scale industries' participants was 47 years while that of the non-participants was 36 years. The table also revealed that over 60 percent of the sampled women households were married. The average school years and household size of both groups stood around 8 years and 6 persons per family respectively. 61 % of the sampled micro and small scale industries' participants and only 49 % of the non-participants were polygamous. The participants had more dependants than the non-participants. The table also depicts that about 50 percent of the sampled participants and only 23 % of the non-participants were the heads of their respective households. It also shows that the SMEs participants' income is more than double that of the non-participants.

4.2. Government Entrepreneurship Development Programmes and its Impact on Female Entrepreneurs in Lagos State

The study reveals that Lagos state government has made concerted efforts to encourage women entrepreneurship development and poverty reduction initiatives in the state. These include establishment of vocational and skills acquisition centres, Lagos State Micro-finance Institution (LASMI), registered cooperative societies, supply of inputs, building of markets, construction of roads and estates, trade fairs

and exhibitions etc. 85% of women participants in MSMEs have benefited directly from the government various programmes while only 15% claimed that they are yet to receive direct benefits inform of skills acquisition and micro finance. However, all the non-participants respondents did not enjoy any direct benefit from the state government various MSMEs development programmes in the study area. Majority (95%) of the beneficiaries of the government MSMEs assisted programmes claimed that the support was not adequate especially the micro-finance loans.

4.3. Decomposition of Sampled Female Households Poverty by Household Expenditure

As shown in Table 2 above, the non-participants have higher poverty incidence, depth and severity than the MSMEs' participants. The non-participants female households had poverty incidence of 60.2%, poverty depth of 23.2% and poverty severity of 4.2% whereas, the MSMEs participants' households had poverty incidence of 14.8%, depth of 6.2% and severity of 2%. The contribution to poverty indicated that the non-participants households had higher contribution to poverty incidence (70.8%), depth (85.7%) and severity (92.8%) against MSMEs participants' contributions to poverty incidence (29.2%), depth (14.3%) and severity (7.2%). This implies that poverty is more prevalent among the female households that did not participate in MSMEs because of their lower per capita expenditure than the female entrepreneurs. It is also evident that the non-participants accounted for the greater poverty level in the study area.

Table 3. Determinants of Poverty and Impact of Entrepreneurship Development on Female Households

| VARIABLES | COEFFICIENTS | STANDARD ERROR | t-VALUE |
|----------------------------|--------------|----------------|---------|
| Constant | 5.5432 | 1.8780 | 2.5050 |
| Age | 0.0329 | 0.0372 | 0.1170 |
| Marital Status | 0.7533* | 0.3362 | 2.4507 |
| Educational Status | -0.4336*** | 0.1965 | -1.4250 |
| Women status in the family | 2.9352*** | 0.7783 | 2.4795 |
| Participation Index | -4.6433*** | 1.0976 | -2.6770 |
| Income | -0.0067* | 0.0004 | -2.8452 |
| Government assistance | -0.2104 | 0.1610 | 2.6667 |
| Micro-finance loans | -0.0411 | 0.0052 | -0.2222 |
| Household Type | -0.6433*** | 0.2688 | -1.8754 |
| Household Size | 2.5570* | 0.3711 | 5.2652 |
| Dependency Ratio | -0.5336*** | 1.0976 | -1.4250 |
| Adjusted R-square | 0.5114 | | |

Asterisks denote significance *** at 1%, ** at 5% and * at 10%

4.4. Determinants of Poverty and Impact of Entrepreneurship Development on Female Households

The results of the Probit regression analysis of the determinants of poverty among female households in Lagos State and effect of their participation in small scale enterprises are presented in Table 3 below.

The result showed that adjusted R^2 value was 0.5114 meaning that 51.14% variability in the dependent variable is explained by the exogenous variables included in the model. The model is statistically significant at the 1% critical level. This indicates that the model has a good fit to the data. The correlation coefficient (B_0) is estimated at 5.5432 and this represents the independent poverty depth (P_0) among the female households in the study area. As shown in the Table, eight (8) variables were statistically significant in all the eleven (11) explanatory variables included in the model. Educational status, women household status, participation in Micro Small Scale Enterprises (MSMEs), household type and dependency ratio variables are significant at 1% while marital status, income and household size are significant at 10%. The coefficient of each variable is related to the independent poverty depth as follows: The coefficient of the intercept of dummy of the marital status of the women is 0.7533. This indicates that the autonomous poverty level of the women will be increased by 0.7533 to become 6.2965 while that of unmarried women will remain as 5.5432. This may be connected to the fact that married women have a larger household size than the unmarried counterpart and this will decrease the per capita income.

Household type also has a significant effect on the poverty level of the sampled women. The coefficient of the variable is -0.6433 . Therefore woman with a monogamous household has a reduced poverty level by 0.6433 to 4.8999 while the poverty index of woman in a polygamous household is 5.5432. This confirms the fact polygamous households have a larger household size and dependency ratio. For the household size which has a coefficient of 2.5570, it implies that a unit increase in household size will increase the poverty of the household by 2.5570 because larger household size will result to low household per capita expenditure. For educational status, the poverty level of the women will be decreased by 0.4336, while for the status of women in the family, as either household head or not, the poverty level of women will be increased by 2.9352 if there is a unit change in their status. Participation of women in MSMEs has a coefficient of -4.6433 . This implies that the poverty depth of the women will be reduced by 4.6433 to 0.8999 if there is a unit increase in participation by women in MSMEs. Also, a unit increase in income level of women households will reduce the poverty status by 0.67% because an increase in disposable income implies increase in household per capita expenditure, and hence, possibility of households' escape from poverty.

5.CONCLUSION AND RECOMMENDATIONS

This research primarily focused on the effect of female participation in small and medium scale enterprises on poverty status among women households in Lagos State. It was discovered that participation of women in MSMEs is an effective tool for poverty reduction. Despite government various efforts and programmes to enhance entrepreneurship development in the state, targeted people did not have access to such programmes. Inclusion of entrepreneurial education from primary and post primary institutions to achieve entrepreneurial skills will reduce poverty status of women households. Incubatory centers should be provided to make entrepreneurial education practical oriented and encourage the trainees to put acquired skills into use and gain confidence to start their own enterprises. There is need for birth control to reduce dependency ratio which positively makes household to be poor. There is need for enlightenment campaign to create awareness on the existing vocational and skills acquisition centers to increase MSMEs' participants with a view to escaping poverty. Government should create enabling environment by providing infrastructures and adequate assistance that would make infant and extant entrepreneurs' access required inputs and other incentives to enhance their business success. Households should be encouraged to join cooperative societies. This would afford them access to some government and donor agencies assistance and support to entrepreneurs.

REFERENCES

- Adejobi, A.O. (2004) "Rural Poverty, Food Production, And Demand in Kebbi State, Nigeria. Unpublished Phd Thesis, Department Of Agricultural Economic, University of Ibadan, 1-88.
- Adofu, I., & Ocheja, A. (2013). Alleviating Poverty Through The Use Of Entrepreneurship Skill Acquisition In Kogi State, Nigeria. *International Open Journal Of Economics* 1(2): 14-23.
- Aliyu, A. (2003). Perspective Of Poverty Alleviation Programmes In Nigeria. Report Of The Conference On Empowerment, Gendering And Social Change In Africa And African In Diaspora. *Echo*, No. 19.4th Terms 1819.
- Asikhia, O. (2010) "Smes And Poverty Alleviation In Nigeria: Marketing Resources And Capabilities Implications". *New England Journal Of Entrepreneurship*, 13(2): 57-70.
- Buttner, E. H. (2003) "Female Entrepreneurs: How Far Have They Come?" *Business Horizons*, 36(2): 59-65.
- Collerette, P., & Aubry, P. G. (2001) "Socio-Economic Evolution Of Women Business Owners in Quebec", *Journal Of Business Ethics (Netherlands)*, 9(4): 417-422.
- Drucker, P.F. (1985) "Innovation And Entrepreneurship: Practice And Principles". New York: Harper And Row.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Fajimi, F.O., and Omonona, B.T. (2011) "Women Participation in Agro-Allied Small and Medium Scale Enterprise and Its Impact on Poverty Alleviation in Oyo State Nigeria. *International Journal Of Agric. & Environment*, (01): 27-37.
- Hisrich, B. (2001). Failure Of SMEEIS Led To Microfinance Bank. Business Day, Wed, Feb.15th.
- Ijaiya, G.T. (2000) "Feminization of Poverty in Nigeria: A Case Study Of Households in Ilorin Metropolis", *African Journal Of Business And Economic Research*, 1(2): 141-148.
- International Labor Organization, ILO (2005). Globalization And Gender Briefs. Series No.3.
- Kirkwood, J. (2009) "Is Lack Of Self-Confidence Hindering Women Entrepreneurs", *International Journal Of Gender And Entrepreneurship*, 1(2): 118-133.
- Kuratko, D.F., & Hodgetts, R.M. (2004) "Entrepreneurship: Theory, Process And Practice". Mason, OH; South-Western Publishers.
- Misango, S.B., & Ongiti, O.K. (2013) "Do Women Entrepreneurs Play A Role in Reducing Poverty? A Case in Kenya". *International Review of Management and Business Research*, 2(1): 1-17.
- Noble, B.P. (2006) "Women Entrepreneurs: The New Business Owners: A Sense Of Self", *Venture*,
- Odejide, A.F.C. (1997) "Breaking The Vicious Circle of Poverty Among Women in Developing Countries: The Case For Microcredit". *Proceeding Of The Nigerian Economic Society Annual Conference On Poverty Alleviation In Nigeria*. Ibadan NES, 367-381
- Odoemene, A.C. (2003) "African Women and Economic Development", 1900-1995: The Nigerian Experience. Paper Presented At South African Sociological Association (SASA) Annual Congress.
- Olu-Aderounmu, W.O., Ossai, G.O., & Oladele, R. (2012) "Introduction To Entrepreneurship and Small -Scale Business Management". *Institute of Entrepreneurs*, Ikeja. 1-135.
- Omotola, J.S. (2008) "Combating Poverty for Sustainable Human Development in Nigeria: The Continuing Struggle", *Journal Of Poverty*, 12(4): 496-517.

**ANA AKIM İKTİSADIN GELİŞMESİNDE WASHINGTON UZLAŞMASI'NIN ROLÜ
ÜZERİNE BİR DEĞERLENDİRME**

Selçuk KOÇ*

Ayhan ORHAN**

Sema YILMAZ GENÇ***

Erkan OFLAZ****

ÖZET

Petrol İhraç Eden Arap Ülkeleri Birliği'nin 1973 yılında meydana gelen Arap-İsrail savaşında İsrail ordusuna destek veren ülkelere yönelik başlattığı ambargonun yarattığı kriz, uluslararası finansın yaşadığı en büyük krizlerden biri olma özelliğini taşır. Bu krizin bir borç krizi haline gelmesinin nedeni, gelişmiş ülkelerin, az gelişmiş ve gelişmekte olan ülkelere karşı talep sorununu aşmak adına kullandıkları kredilerdir. Kredilerin ödenemeyecek bir hal almasının nedeni kriz başlangıcına kadar geri ödeme potansiyeli hesaba katılmadan alınan ve daha çok popülist politikalara kullanılan dış kredilerdir. Hem kapitalist ülkelerin muhafazakâr kanadında hem de IMF ve Dünya Bankasının kemer sıkma politikaları nedeniyle gelişmekte olan ülkelerin halkları tarafından ciddi eleştirilere maruz kalan bu politik yaklaşım sonucunda Washington Uzlaşması olarak bilinen kavram Washington merkezli finans kuruluşlarınca gündeme getirilmiştir. Genel politika çözümleri olarak sunulan 10 maddelik reçete ülkelerin finansal durumlarını iyileştirip borçlarını ödeyebilme kapasitesini arttırmaya yönelik olduğu varsayılmaktadır. Eleştirel yaklaşım ise bu konuya daha çok ekonomik hegemonyanın hegemonyaya bağımlı ülke piyasalarına yön verme arzusu olarak nitelendirilmiştir. Genel anlamda Washington uzlaşması, uluslararası şirketlerin diğer ülkelerin iç pazarlarında rekabet olasılığını arttırmak için düzenlenmiş bir dizi önlemdir. Eleştirel bakış ile Washington uzlaşması, liberal ekonomilerin diğer ülke ekonomilerine daha rahat adapte olma isteğidir. Uzlaşmanın borç krizi nedeniyle ortaya çıkmıştır ve diğer ülkelerin iç piyasalarını hareketlendirme amacı taşır. Bu haliyle Washington uzlaşması, Milliyetçi ve Marksist görüşün eleştirilerinin odak noktası olmuştur. Bu çalışma uluslararası finans bağlamında Washington uzlaşmasına yöneltilen eleştirileri inceleyecektir.

* Kocaeli Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, selcukkoc@kocaeli.edu.tr

** Kocaeli Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, aorhan@kocaeli.edu.tr

*** Kocaeli Üniversitesi, KMYO, Pazarlama ve Reklamcılık Bölümü, semayilmazgenc@kocaeli.edu.tr

**** Kocaeli Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, İktisat Teorisi ve Tarihi, erkan-oflaz@hotmail.com

**AN EVALUATION ON THE ROLE OF WASHINGTON CONCESSION IN DEVELOPING
MAINSTREAM ECONOMICS**

ABSTRACT

The embargo by the Oil Exporting Union of Arab States against the countries that support the Israeli army in the Arab-Israeli war in 1973 creates the crisis which is one of the biggest crises experienced by international finance. The main reason for this crisis to become a debt crisis is the credits given by developed countries to underdeveloped and developing countries. One of the reasons why the credits cannot be paid is the external loans that are taken without considering the possibility of reimbursement and are generally used for populist policies. The concept, known as the Washington Consensus, has been raised by Washington-based financial institutions as a result of this political approach, which has been criticized not only by the conservative wing of the capitalist countries, but also by the people of the developing countries affected by the IMF and World Bank austerity policies. As a policy solution, this ten-point suggestion is for countries to improve their financial status and to increase their capacity to pay their debts. Critical approach has defined this issue as the desire of economic hegemony to direct the dependent markets. The Washington consensus is a set of measures designed to increase the chances of international companies competing in the internal markets of other countries. Critically, the Washington consensus is defined as the desire of liberal economies to adapt to the economies of other countries more easily. The Washington Consensus was created because of the debt crisis. For this reason, it is one of the main objectives of reviving the domestic markets of other countries. Therefore, the Washington consensus has been criticized by the nationalist and Marxist views. This study will examine the criticisms of Washington consensus in the context of international finance.

Keywords: *Washington, Consensus, International Finance, IMF, World Bank*

JEL Codes: *E50.*

1.GİRİŞ

“Eğer sorun büyük mali açıkların beslediği makroekonomik istikrarsızlık ise bilindik bir istikrar programı, ticaret serbestliği veya büyük ölçekli sanayi reformu olmaksızın bile büyüme için harikalar yaratır.” (Dani Rodrik)

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Washington Uzlaşması kavramı ilk kez John Williamson tarafından 1989 yılında kullanılır. Uzlaşmanın küresel anlamda ön plana çıkmasında iki önemli unsur rol oynar: Bunlardan ilki, 1950-1960'lı yıllardaki kalkınma ideolojisi ve uygulamalarının başarısızlığı ikincisi ise uluslararası finansal kurumların desteği ile yapısal reformların gerçekleştirilmesidir (Williamson, 2003: 10–12).

IMF ve Dünya Bankası gibi uluslararası kuruluşların düşüncelerini yansıtan ve temelde 1980'li yılların başlarından itibaren yapısal uyum programları ile IMF ve Dünya Bankası tarafından üyelerine uygulattırılan politikalar, çeşitli iktisadi akımlar tarafından farklı algılanmış ve ciddi eleştirilere hedef olur. Uluslararası ticaret ve finansın ana aktörlerinden olan devletler ve uluslararası finans kurumları, petrol krizi ile başlayan ve kısa sürede bir borç krizine dönüşen bir tehtitle karşı karşıya kalırları. Bu yeni durum aslında piyasa aktörlerinin, Pazar olarak gördüğü ülkelerdeki talebi düşük faizli kredi enjeksiyonları ile canlandırma düşüncesinden kaynaklanır. Her ne kadar teoride uygulamanın geri dönüşü talebi artırarak daha fazla ürün ihracı olarak düşünülse de, düşük maliyetli kredileri alan gelişmekte olan ülkelerin karar vericileri bu finansmanı daha çok popülist politikalarda ve/veya katma değer yaratmaktan uzak yatırımlarda değerlendirdiler. 1973 yılından sonraki petrol fiyatlarındaki dramatik artışlar ve finansman maliyetlerindeki artış nedeniyle borç stoku, gelişmekte olan ülkelerde yaklaşmakta olan bir krizin öncü şokları niteliğindedir. Finansman sağlayıcı durumunda olan ve uluslararası piyasayı düzenleyen *IMF* ve *Dünya Bankası* gibi kuruluşların mevcut borç stoku nedeniyle yeni krediler sağlamakta isteksiz davranması, gelişmekte olan ülkelerin döviz ihtiyacını tolere edilemez bir noktaya getirir. Meksika Hükümetinin 1982 yılında moratoryum ilan etmesi ile borç krizi, artık sadece gelişmekte olan ülkelerin etkilenmeyeceği bir seviyeye taşınmış olur.

Uluslararası finans kurumları eleştirel bakış açısından, “*gelişmekte olan ülkelerin ekonomi politikalarının ülkenin karar vericilerine bırakılmayacak kadar riskli olduğu*” düşüncesini öne sürerek yeni finansman desteğini çeşitli politikaların uygulanmasına bağlarlar. Temelde politika tavsiyesi veren ülke/uluslararası finans kurumları tavsiye edilen politikaların iç pazarı canlandıracağını, doğrudan yatırımı teşvik edeceğini ileri sürerler. Buna karşın politikanın uygulanması, hedef ülke ekonomilerindeki ekonomik bağımlılığı arttıracığı ve ülke ekonomilerinin kontrol mekanizmalarını işlevsiz bırakacağı algısı oluşturmaktaydı. Ana iktisadi düşünceler önerilere yöneltilen eleştirilerin haklılığı konusunda şüphesiz faydalı olacağından ele alınarak incelenir.

2. BAĞIMLILIK VE İKTİSADİ GELİŞME

20. yüzyılın insanlık tarihine kattığı en önemli olgu iletişim ve ulaşım teknolojilerinde ki gözle görülür hızlanma ve değişiklidir. Yüzyıl öncesinden çok büyük problemler ile aşılanacak mesafeler ve ulaşılacak bilgi yeni yüzyılda saatlerle ölçülmektedir. Ekonomiye yansması ülkelerin ve sistemlerin her ülke için karşılıklı etkileşim ve bağımlılık olarak öne çıkmıştır (Waltz, 1979). Küresel dünya, küresel bir piyasa oluşturmuş ve küresel piyasada ki aktörler küresel piyasanın vazgeçilmez öğeleri haline

gelmiştir. Küresel piyasanın bireyleri olan devletlerin bir ya da bir kaçında meydana gelen ekonomik kriz ve/veya durgunluk küresel piyasayı tamamen etkilemektedir.

Bu durumda ülkelerin küresel piyasanın etkisinde ve çekim alanında olması yadsınamaz bir gerçektir. Küresel piyasanın özelinde her devletin kendi ekonomisini çeşitli görüşler üzerine inşaa ettiği bilinmektedir. Bu görüşler tam bir uygulama alanı bulmamış olsada yön verici ana güçtür diyebiliriz. *Ekonomi politigin üç ideolojisi olarak adlandırılan piyasanın, ekonomik büyümede ve zenginliğin gruplara ve topluma dağıtılması yönünde ki rolü nedir? Piyasanın iç ve uluslararası toplumun organizasyonunda rolü ne olmalıdır? Piyasa sisteminin savaş ve barış konularında etkisi nedir? Bunlar ve benzeri sorular uluslararası ekonomi politik temelini oluşturmaktadır.* (Gilpin, 2015) Bilim insanları ekonomi ve siyaset arasında ki ilişkiyi açıklamak için birçok yöntem kullanmış olsa da en dikkat çekici olanları liberal, milliyetçi ve marksist görüştür (Lindblom, 1977). Makalemizin amacı uluslararası piyasayı yönlendirme amacına hizmet eden bir doktrini açıklamak olduğu için, bu doktrinleri özetle ele alınması gereği değerlendirilmektedir.

2.1.Liberal Görüş

Ekonomik ve siyasi liberal teorilerin kaynağını aldığı bir dizi değerler vardır. Modern dünyada bu siyasi ve ekonomik değerler birlikte görünme eğilimindedir (Lindblom, 1977). Liberal ekonomi serbest piyasa ve asgari devlet müdahalesine dayanmaktadır. Bu yönüyle minimal görüşü savunur. Klasik/Neo klasik iktisat ekolünün ana teması liberal ekonomidir. Liberal ekonomi aynı zamanda Keynesyen ve Monetarist görüşler içinde ana zemini oluşturmuştur. Ekonomik liberalizm piyasa da insan ihtiyaçlarını karşılamak için herhangi bir müdahale olmaksızın insanların kendi mübadeleleriyle doğup gelişen ve piyasa mekanizması tarafından belirlenen şartlarıyla ekonominin kendi kendini yönlendireceğini düşünmektedir (Gilpin, 2015). Asıl itibariyle Washington uzlaşmasının temelinde neo-klasik iktisat ekolünün etkisi olduğu söylenebilir. Bu yönüyle liberal ekonomi düşüncesi diğer ekonomi düşüncelerinden ziyade Washington uzlaşmasını destekleyici bir yönü vardır.

2.2.Milliyetçi Görüş

Ekonomide milliyetçi görüş genel olarak savunmacı bir duruş sergilemektedir. Bu savunmacı duruşu, Gilpin “iyi huylu Merkantalizm” olarak adlandırmıştır. Liberal akımın aksine milliyetçi akım, güç ve ekonomi ilişkisini birbirinin ardılı değilde tamamlayıcısı olarak değerlendirmektedir. Ekonomik milliyetçiler uluslararası ilişkilerde ekonomik faktörlerinin rolünün üzerinde önemle dururlar. Devlet yapısı her ne olursa olsun ekonomik gücü mili gücün odağına koyarlar. *Ekonomik kaynaklar milli güç için gerekli olduğundan her çatışma hem siyasi hem de ekonomiktir* (Hawtrey, 1952). Milliyetçi görüş ekonomik varlıkların gücüne inanır. Bu ekonomik varlıklar gerek doğal kaynaklar gerekse mevcut fabrika ve teknoloji yatırımlarının ulusal güce etkisi ile ilgilenirler. Paradigma ekonomiyi geliştirmek ve korumak üzere şekillenir.

2.3. Marksist Görüş

Karl Marx ve Freidrich Engels tarafından ortaya konulmuştur. Marx kapitalizmi küresel ekonomi olarak görsede sistematliğini uluslararası ilişkilere yaymamıştır. Marksist ekonominin doğası kapitalizme karşı bir karşı durum ve devrimdir. Bu karşı duruş ve devrim nihayetinde merkezi planlamayla yönetilecek ekonomi sürecinin ve tüm piyasa mekanizmasının eşgüdümünü öngörmektedir. Piyasa ekonomisinin eşgüdümü liberal görüşteki gibi piyasanın aktörleri arasında bir dengeden ziyade merkezi karar mekanizmalarıyla eşgüdüm uygulamak istenmektedir. Marksist görüşün konumuza etkisi Washington uzlaşmasının doğasında bulunan piyasalar arasında dengeyi sağlama çabasının eşgüdüm ile ortaya konulabileceği düşüncesidir. Hâlbuki piyasa, daha çok denge arayışı içindedir. Marksist görüşte ticari yatırımı ve zenginliği gruplar ve toplumlara dağıtılmasında bir üst yapı gereği vardır (Bocutoğlu,2012). Bu da devlet gücünü akla getirmektedir. Gerek ulusal gerekse uluslararası düzeyde iş bölümü Washington uzlaşmasının finansal araçlarda oluşturmaya çalıştığı eş güdümü doğasına uygundur. Diğer yandan mülkiyet, özelleştirme ve kamunun minimal etkisi marksist teorinin dışladığı hususlardır.

2.4. Az Gelişmişlik Sorunu ve Eşitsiz Büyüme Süreci

Washington uzlaşmasının ele alındığı ve sıkça kullanıldığı, 1980'li yıllar uluslararası piyasanın gelişmiş ve gelişmekte olan ülkeler arasında ki gözle görülür refah farkının nedenlerinden birisidir. 1980'li yıllarda ortaya konulan Washington uzlaşması reçetesi gelişmekte olan ülkeler için piyasa adaptasyonu ve gelişim için bir umut olmuşsa da, eşitsiz büyüme süreci ve piyasanın gelişmiş ülkeler lehine oluşturduğu habitat, reçeteyi uygulaması gereken ülkeler için 1990'lı yılların başında istenmeyen sonuçlar doğurmuştur. Finans ve piyasa sisteminin toplum için refah üreten bir duruma getiren gelişmiş ülkelerin, aşırı borç ve ekonomik dar boğazlar içinde bulunan gelişmekte olan ülkelere uygulamak istediği Washington uzlaşması, gerek toplumsal gerek ekonomik bir dizi negatif sonuçlar doğurmuştur. Negatif sonuçların başında, hiç şüphesiz gelir dağılımı adaletsizliği, ikincil sonuçlar olarak da yolsuzluklar ve yapısal reformların zamanında ve uygun şekilde yapılmaması diye sıralayabiliriz. Unutulmamalıdır ki eşitsiz büyüme süreci sadece toplumsal değil, uluslararası sıkıntılarada sebebiyet vermektedir. Gilpin tarafından hegenomik savaş olarak tanınan bu süreç, bir ya da bir kaç ekonominin diğer ekonomiler üzerine baskı ve hegemonya kurma yoludur. Genel bir düşünce sistemi olarak Antik Yunandan itibaren geçerliliğini koruyan bir doğrunun her zaman ve her koşulda güzel ve iyi sonuçlar doğurmayacağı ve doğurduğu sonuçların kişi ve kurumlara aynı etkiyi yapmayacağı unutulmaması gereken bir gerçektir. Washington uzlaşmasının doğasında bulunan liberal ekonomik sistemi kabul etmişlik durumu uzlaşmanın uygulandığı ülkeler için aynı sonucu doğurmamıştır. Montesquieu'nun ünlü sözü olan "*barış ticaretin doğal etkisidir*" sözü her ne kadar Washington uzlaşmasının düşünce temelinde yatan bir olgu olduğu düşünülse de, eşit şartlara haiz bulunmayan diğer piyasa ekonomileri yeni duruma adapte olamamışlardır.

3. WASHINGTON UZLAŞMASI KAPSAMINDA ULUSLARARASI FİNANS

Washington uzlaşması uluslararası finansı üç aktör üzerinden değerlendirmiştir. Bu aktörler borç veren kurum ve kuruluşlar (devletler), borç alan kurum ve kuruluşlar (devletler) ve bu finansal sistemi denetleyip sağlıklı bir şekilde ilerleyebilmesi için gerekli uluslararası kurum ve kuruluşlar olarak niteliyebiliriz. Uluslararası finansın uygun amaca hizmet etmesi bağlamında alınan ve verilen kredilerin kamu maliyesinde uygun ve efektif olarak kullanılması geri ödeme ve ödeme finansmanının uygun şekilde tedarigi adına çeşitli politika önerileri ortaya atılmıştır. Bu politika önerileri on başlık altında toplanmıştır.

Washington Uzlaşması 10 maddeden oluşmaktadır (Williamson, 2005):

Maliye disiplini sağlanmalı ve ülkelerin bütçeleri denk olmalıdır; çünkü bütçe açığı, daha çok, gelişmekte olan ülkeleri etkileyen ödemeler dengesi krizlerine ve enflasyona neden olmaktadır. Gelişmiş ülkelerin ulusal paraları daha güvenli olduğundan bütçe açığı sorunundan daha az etkilenirler.

Kamu harcamalarının öncelikli alanları yeniden düzenlenmelidir. Harcamalar, uzun dönemde iktisadi büyümeyi artıracak ve daha eşit gelir dağılımını sağlayacak yüksek verimli alanlara; eğitim, sağlık ve alt yapı sektörlerine yapılmalıdır.

Vergi reformu yapılmalıdır. Ülkeler artan oranlı vergilerden vazgeçmeli ve vergi tabanını genişletmelidir.

Finansal serbestleştirme ile beraber faiz oranlarının belirlenmesi de piyasaya bırakılmalıdır.

Döviz kurları rekabeti engellemeyen ve tek tip (unified) olmalıdır. Döviz kurlarını da piyasa belirlemelidir. Aşırı değerli, düşük değerli veya çeşitli sektörlerle farklı döviz kuru uygulamaları sanıldığı aksine, ihracatı ve büyümeyi engeller. Özellikle finans piyasasının önünde bir engel olmadığı zamanlarda döviz kurlarının aşırı dalgalanması, ülke ekonomilerini olumsuz etkileyeceğinden burada daha çok anlatılmak istenen dalgalı döviz kuru politikasıdır.

Gümrük tarifeleri kaldırılmalı ve serbest dış ticaret anlayışı güdülmelidir.

Doğrudan yabancı sermaye yatırımları özendirilmeli, yabancı sermayeyi çekmek için cazip yatırım ortamı oluşturulmalıdır.

Devlet girişimleri özelleştirilmelidir.

Devletin piyasa üzerindeki düzenlemeleri kaldırılmalıdır (Deregülasyon).

Mülkiyet hakları korunmalıdır. Bu özellikle bilişim sektörlerinin gelişmesini sağlayacaktır.

Bu tavsiyeler liberal düşünce ekolünden ana akım iktisat temelli piyasa ekonomisinin temel savlarıdır. Fakat 1980'lerin borç krizinde uygulanan bu politikaların 1990'ların başında ortaya çıkardığı sonuç, istenen sonuçları ortaya koymamıştır.

4. ULUSLARARASI FİNANSTA BORÇLANMA SORUNU VE KRİZLER

Dünya 1980'li yıllara girerken toplam dünya borç tutarı: 1930'ların başlarında ki 100\$ milyar seviyesinden 1980'lerin ortalarında 900\$ milyar civarına yükselmiştir. Time dergisinin isabetli ifadesiyle “*Tarihte hiçbir zaman bu kadar çok ulus bu kadar çok parayı bu kadar az ödeme umuduyla borçlanmamıştı*” (Time, 10 Ocak 1984; Gilpin,2015). Gerçektende dünya ikinci dünya savaşının sonunda parasal bir genişleme ve ucuz maliyetli kredilerle finanse edilme dönemi yaşamıştır. Ucuz krediler beraberinde gerek politikacıların gerekse ekonomik aktörlerin hatalarıyla olması gerektiği gibi harcanmamış, yatırım ve finansman desteği yoluyla reel ekonominin kullanımına sevkedilmemiştir. Bu durum kredi faizlerinin yükselmesiyle birlikte dramatik bir şekilde değişmiş ve kendi sanayisini kurmak umuduyla alınmış olan borçların geri ödemesi beraberinde büyük bir finansal krize sebebiyet vermiştir. Petrol kriziyle beraber maliyetlerin artması ve enflasyonist baskı faiz hadlerinin değişmesine ve bu da borçlu olan ülkelerin geri ödemelerinde büyük sıkıntılara neden olmuştur. Piyasanın önce durgunluğa daha sonra krize girmesinin nedeni tam olarak budur. Bu krizi aşmanın iki yönlü tepkisel merkezi vardır. İlk, daha önceden kolaylıkla borçlanabilen ülkelerin yeni borçlanmalar yapamaması, daha önce borç vermeye istekli kurumların ise yeni oluşan ortamda eskisi kadar kolay borç vermemesi piyasanın daha da kötüleşmesine neden olmuştur. İkincil olarak, Uluslararası kuruluşların konuyu Washington uzlaşması ile aşmaya çalışması yeni bir düzenin habercisi olsa da on yıllık süre sonunda Washington uzlaşmasının işlerliği ve masumiyeti sorgulanır hale gelmiştir.

5. WASHINGTON UZLAŞMASININ BAŞARILARI VE BAŞARISIZLIKLARI

Washington uzlaşmasının fikir babası neo-liberal iktisat ekolünden Friedrich Hayek ve Milton Friedman'dır. Bu politikalar Güney Amerika ve diğer borçlu ülkeler üzerinde uygulandığı dönemde ortaya çıkan sonuçları o ülkeler adına talihsiz diyebileceğimiz sonuçlara neden olmuştur. *Latin Amerika ülkelerinde politikaların olumsuz sonuç doğurması, Latin Amerika entellektüellerinin bu konuyu olumsuz çağrışımlar olarak yorumlamasına neden olmuştur* (Yıldırım, 2011). IMF ve Dünya Bankasının önermesiyle şekillenen Washington uzmanlaşmasının politikalarına yönelik devletin işlevini yeniden sorgulamaya açan ve uygulandığı dönemde Doğu Asya ülkelerinin gösterdiği ekonomik performans nedeniyle eleştiri alan bu politikalar tepkiyle karşılanmış ve gözden geçirilmesi gereği ortaya çıkmıştır. Washington uzlaşmasının genel modeli istikrar içinde ki ana akım iktisat modelini uygulayan liberal ekonomiler için gelecek vaad etse de uygulamada, Güney Amerika ve Sahraaltı

Afrikasında ki ülkeler bu modele yapısal olarak hazır olmadığından başarılı olunamamıştır. Tavsiye edilen finansal serbestliğin oluşumu için gerekli olan Merkez bankalarının serbestliği meselesi, hedef ülkelerin politka yapımcılarının isteksiz olduğu ama finansal güvenirliliğin parametrelerinden olan bir diğger unsurdur. *Merkez bankalarının bağımsızlık düzeyi daha yüksek olan ülkelerin, 70'lerde başlayan ve gelişmiş ülkelerde 80'lerin, gelişmekte olan ülkelerde ise 90'ların başlarına kadar devam eden enflasyon dalgasından, hem daha az etkilendikleri hem de enflasyonu düşürmede daha az bir maliyete katlandıkları görülmektedir* (Büyükkakın, 2004). Washington Uzlaşmasının Başarıları ve Başarısızlıkları, hedef ülkenin politka yapımcılarının uygulamaları ile bağılı olduğu görülmektedir.

6.SONUÇ

Hayek ve Friedman'ın başını çekmiş olduğu neoklasik iktisadın Amerika'nın Washington şehrinde gelişmekte olan ülkelerin 1980 yılında baş gösteren borç kriziyle mücadelesi için uygulamaya konulmuş çözüm önerileri 90'lı yılların sonunda başarısızlığa uğramıştır. Gerek uzak Asya'nın (Çin, Endonezya vb) ülkelerinin başarılı ekonomik grafiği gerekse programın uygulandığı ülkelerin yönetim biçim ve algısı nedeniyle uygulamaya konulan liberal politikalarda başarılı olunamamıştır. Başarısızlığın faturası ise az gelişmiş ülkelerin sosyal çevrelerinde hegemon güç olan Amerika'nın ve diğger gelişmiş ülkelerin gelişmekte olan ülkeler üzerine kurmak istedikleri sosyo-ekonomik baskının bir yansıması olarak algılanmış ve tepkiyle karşılanmıştır. Genel itibariyle Washington uzlaşması gerek uygulamasında ki eksikler gerekse uygulama araçlarının yetersizliği nedeniyle uygun şekilde ele alınamamıştır. Bu nedenle piyasa ekonomisinin tam anlamıyla hayata geçirilmesi beklenen ülkeler daha sosyalist ve milliyetçi politikalar izlemeye ve bu izledikleri politikayla uluslararası finans aktörlerinin gelmelerini istedikleri noktadan daha uzağa savrulmuşlardır. Günümüzde hala gelişmekte olan ülkeler kırılğan ekonomilere sahip olup uluslararası ortamdaki liberal piyasa ekonomilerine ayak uyduramamış, ekonomik olarak stabil hale gelmemişlerdir.

KAYNAKÇA

Bocutoğlu, E. (2012) "İktisadi Düşünceler Tarihi", Murathan Yayınevi.

Bocutoğlu, E. (2012) "İktisat Teorisinde Emeğin Öyküsü: Değerin Kaynağı Olan Emekten Marjinal Faydanın Türevi Olan Emeğe Yolculuk". Hak İş Uluslararası Emek ve Toplum Dergisi, 1(1).

Gilpin, R.(2012) "Uluslararası İlişkilerin Ekonomi Politliği". Kripto Yayınları.

Hawtrey, R. G. (1952) "Economic Aspects of Sovereignty (London, 1930)" Theoretical and Historical Aspects, 7: 27.

Waltz, K. N. (2010) "Theory of International Politics", Waveland Press.

Lindblom, C. E. (1977) "Markets and Politics", New York: Basic Books.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Williamson, J. (2004) "The Strange History of The Washington Consensus", Journal of Post Keynesian Economics, 27(2): 195-206.
- Yıldırım, C. (2011) "Neoliberal İktisat Politikalarının Türkiye'de Orta Sınıfa Etkisi", Yayınlanmış Doktora Tezi, Abant İzzet Baysal Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, İktisat Anabilim Dalı.
- Aydın, K. (2003) "Kapitalizm ve Kriz", Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi (6): 1-10
- Büyükakın, T. (2004) "Güvenilir Bir Para Politikası Stratejisinin Kurumsal Çerçevesi", Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, (7): 1-21.
- Tekgül, Y., Cin, M. F.(2014). Neoklasik Paradigma Olarak Washington/Post Washington Uzlaşısının Yükselişi Ve Düşüşü: Post-Keynezyen Alternatif Yaklaşım. Çukurova Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, 24(2): 247-262.
- Duman, M. (2002). Hegemonya ve Güçler Dengesi Bağlamında Uluslararası Siyaset ve İktisat İlişkileri. Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, (4): 1-16.
- Gürkan, C., Karahanoğulları, Y. (2014). Neoliberalizmin krizi ve kamu maliyesi. Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, (27): 1-19.
- Erim, N., & Türk, A. (2005). Finansal Gelişme ve İktisadi Büyüme. Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, (10): 21-45.
- Sak, G., Çağlar, E. (2009). Washington Mutabakatı'ndan İstanbul Kararları'na: Nereye Doğru Gidiyoruz?, Tepav Politika Notu, 1-6.
- Yavuz, G. (2007). Washington Uzlaşması Sonrasında Dünya Bankasından Bir Açılım Önerisi: Kapsamlı Kalkınma İçin Çerçeve, Gazi Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 9(3): 181-196.
- Yıldırım, C. (2011). Birinci ve İkinci Nesil Washington Uzlaşması: Neoliberal İktisat Politikalarının 1980'den Sonraki Evrimi. AİBÜ-İİBF Ekonomik ve Sosyal Araştırmalar Dergisi.
- Williamson, J. (2003). The Washington consensus and beyond. Economic and Political Weekly, 1475-1481.

FOOTBALL MARKET VALUE AND ECONOMIC GROWTH: PANEL DATA ANALYSIS

Fatih MANGIR*

ABSTRACT

The world most popular and valuable team sport, football has attracted various fans from different cultures and investments all over the world. The potential successive years of profits and income in football clubs lead to football club owners make high value of transfers. However, the impact of the market value of national soccer leagues on economic growth has been recently questioned. In this paper, the possible impact of the market value of a national soccer league (=market value per player) on economic growth has been studied.

Focusing the most important and valuable football countries as a market during the period of 2008 and 2016, the panel random effects model was employed to analyze the regression relationship between the value of a soccer league and GDP per capita growth. The result of this study reveals that the selected country's football value has statistically significant positive effect on economic growth.

Key words: *The value of a soccer league, Random effects model, Economic growth.*

1. INTRODUCTION

Until now, football or soccer has the most popular and profitable sport type with her millions of fans and high market volume. In order to boost their profits, the football clubs have still increased their competitions in generating a range of revenue, constructing an *infrastructure* and improving investment opportunities.

Almost all countries also try to determine all factors to expand the capacities of the football's club to attract more visitors and new players into their countries. Football is not only simple team sport but also is also highly related to the economic issues. Football activities have gained important role in countries' economic growth, and this role will be more influential in the future. According to BBC reports, the final revenue of the Brazilian World Cup was estimated to be near \$11 billion (Boettcher and Hobkinson, 2014: 5).

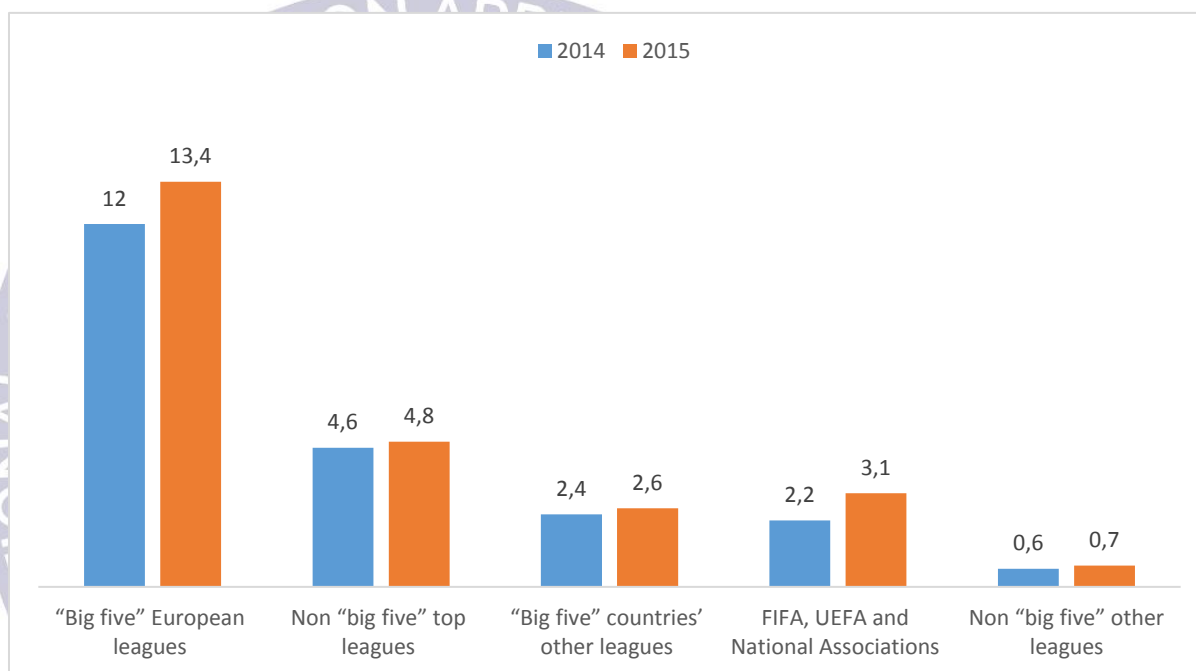
It is increasingly accepted that sport is also an industry in its own right and, in some cases, is even perceived as being a commercial activity (Chadwick and Arthur 2008). Thus, football is also taken as

* Assoc. Prof. Dr., Department of Economics, Selcuk University, Konya, TURKEY, E-Mail: fmangir@selcuk.edu.tr

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

one of the commercial endeavors. For example, Manchester United registered £140 million from TV and broadcasting in 2016. Also, the big five European league, the football revenues increased by €1.4 billion (12%) in 2015/16, and reached 24.6 million Euro and 59% of which was due to increased broadcast, revenues, and 31% due to increased sponsorship and other commercial revenues. In recent years, step-change increases in broadcast revenues have been almost the sole preserve of English Premier League clubs.

Figure 1. European Football Market Size – 2014/15 and 2015/16 (€ billion)



Source: Deloitte-uk, 2017.

The effects of the football revenues on countries economic growth can be divided into separate parts as directly and indirectly. Directly, revenues from football activities such as championships have made a significant contribution to the country's gross domestic product and vice versa. For example, clubs generate more than £6.2 billion in economic output, of which £3.4 billion contributed to the overall UK GDP in the 2013/14 season (Consultancy.uk, 2018). On the other hand, a country with high GDP could increase funds towards sports and education regarding health which will led to better broad athletic performance, in this case on the football pitch (Kapellner and Kostolny, 2014:16).

Indirectly, football clubs and activities also lead to create an essential source of employment facilities for the people in the countries. In terms of employment, footballing activity generated more than 140,000 full-time jobs in 2013, of which more than 66,000 were direct jobs, 60,000 indirect jobs and more than 17,000 induced jobs in Spain (kpmg.es, 2015).

Whether direct or indirect from football activities, one thing is certain that countries must continue invest and expand facilities for football growth and remain internationally competitive and attractive.

In comparison, the European football market has an estimated size of 19.4 billion euros (23.8 billion U.S. dollars). Just less than 50 % of this revenue is generated by the so-called “Big-Five” leagues. The term refers to the top-tier football leagues in England (Premier League), Germany (Bundesliga), Spain (Primera Division), Italy (Serie A) and France (Ligue 1). The Barclays Premier League is the biggest of the five with revenue of 2.9 billion euros (statista.com, 2017).

Therefore, it is very important to investigate the effects of football revenue on economic growth across the counties level. In this study, the effect of football revenue on gdp per capita is also reviewed by considering eleven countries with most valuable football market values over the period of 2008 and 2016. We employed the panel regression analysis with random effect model by including the country's GDP per capita and average market value per football player (million euro) of the selected countries.

In the following parts of the study, the literature part will be reviewed and then the data and methodology body will be defined. Finally, the results will be discussed with the references.

2. LITERATURE REVIEW

In spite of several academic research in sport revenue and economic growth, recently there have been a few attempts to test the effect of football player per market value on GDP. The most existing literature accept football as a main part of sport revenue but still showed the impacts of sport activities or revenues on economic growth.

The study carried out by the European Union in 2011-2012 for members countries utilizing a multiregional input-output methodology found that sport overall is labour-intensive. Therefore, sports can lead to growth by more proportional impact on labour.

Johnstone et all. (2000) showed that Premiership football is more than a dependent consumer service activity in the local economy with a potential for exploitation in terms of supplier networks, tourism and image boosting.

Ahlert (2001) estimated the economic impact of the 2006 World Football Cup on Germany by using an input-output macroeconomic model. He found that German GDP increased by DM 2.9 billion in the year of the 2006.

Conejo et all. 2007 measured the economic impact of particularly football on the regional economy by using input-output analysis covering data from the years 1995 and 2000 in Spanish League. The results of his analysis showed that there was an increase in employment by 18% and the gross value-added by 29%.

Allmers and Maennig (2009) found evidence 700,000 additional overnight stays and US\$900 million in net national tourism income for Germany not for France.

3. DATA and METHOD

A balanced panel data set covering the period of 2008-2016 is used in this study aiming to investigate the effect of football market value on economic growth for 11 countries (England, Spain, France, Australia, Germany, Belgium, Italy, Russia, Netherlands, Turkey and Portugal). Detailed information regarding the variables and data sources taken into consideration in the analysis are provided in Table 1.

Table 1: Data Descriptions and Sources

| Variable | Definition | Source |
|----------|---|--------------|
| RGDP | GDP per capita (constant 2011) | statista.com |
| FV | Average market value per player (million euro). | statista.com |

All data series are annual ranging from 2008 to 2016 and collected from. The analysis of econometric models was done with Stata 14 and Gauss 10 software programs.

We investigated the impact of market value of football player on economic growth in 11 selected countries during 2008-2016 period by employing panel regression. First, we analyzed slope homogeneity with *adjusted delta tilde test* of Pesaran and Yamagata (2008) and the existence of *cross-sectional dependence* by test of Paseran (2004). And then, we estimated the stationarity of the variables by panel second unit root test of CADF (CIPS). Finally, we analyze the effects of football value on growth by running random effects model (REM) model.

4. EMPIRICAL ANALYSIS

Identifying the homogeneity and the cross-sectional dependency tests of variables is an important process to determine correct type of unit roots test.

4.1. Homogeneity and Cross-Sectional Dependency Test

For this reason, we performed the cross-sectional dependency with test by Pesaran, (2004), because time dimension of the dataset (T=8) is smaller than cross-sectional dimension of the dataset (N=11) and the results were presented in Table 2. We concluded that there was cross-sectional dependency among the variables, because probability values were found to be lower than 0.05. Then we tested the homogeneity with delta tilde and adjusted delta tilde tests by Pesaran and Yamagata (2008) and the results were presented in Table 3. We concluded that the slope coefficients were heterogeneous, because probability values were also found to be lower than 0.05.

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES
November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey**

Table 2: Results of Cross-sectional Dependence and Homogeneity Tests

| (Ho : There is cross-sectional independency) | | |
|--|--------------|---------|
| Variable | T-Statistics | p-value |
| GDP | 8.17 | 0.000 |
| FV | 7.68 | 0.000 |
| Homogeneity test (Ho: Slope coefficients are homogenous) | | |

| Test | T statistic | p-value |
|-----------------|-------------|---------|
| Delta_tilde | 2.903 | 0.002 |
| Delta_tilde_adj | 3.470 | 0.000 |

4.2. CADF (CIPS) Unit Root Test

In this study, stationary property of series has been tested by recently developed panel unit root tests which is the CADF test. The CADF panel unit root test is second generation test developed by Pesaran (2007). The difference between first- and second-generation tests is that the latter take into account cross-sectional dependencies, while the former do not (or only to a very limited extent by including common time dummies in the test regressions) (Hossfeld, 2010:11). The test also considers the degree of heterogeneity among the countries.

Table 310: Result of CADF (CIPS) Unit Root Test

| | | Constant |
|-------|---|-----------|
| Lags | | CADF-stat |
| GDP | 1 | |
| Panel | | -3.686** |
| FV | 1 | |
| Panel | | -5.676 ** |

The critical values for the CADF test were obtained from Pesaran (2006), Case I critical values for the CADF test are -2.95 at %5**.

We presented the results of the CADF test in Table 3. The null hypothesis of this test assumes that all series in the panel are non-stationary and if the absolute value of calculated statistic is greater than the critical value, and then we accept that series are stationary.

4.3. Panel random estimation results

Finally, we performed panel OLS regression model to estimate the football player value on economic growth during the years between 2008 and 2016. OLS panel regression equations can be estimated by mostly fixed or random effect techniques.

In panel regression, individual's variables are assumed to be the same coefficients. However, some variables are very different and so should include individual intercept. An individual intercept (α_i) are include to control for individual-specific and time-invariant characteristics (Muck, 2018). That parameters are called fixed effects estimators.

On the other hand, the random effect estimator is used if the individual-specific component is assumed to be random with respect to the explanatory variables (Uğurlu, 2010:49).

Hausman test was conducted to choose fixed or random estimation method in panel regression (Table 4).

Table 411: Hausman Test Results

| Variable | Coefficients | | | |
|----------|--------------|----------|------------|---------------------|
| | (b) | (B) | (b-B) | sqrt(diag(V_b-V_B)) |
| | fe | Re | Difference | S.E |
| Fv | .001681 | .0016207 | .0000572 | .0000604 |

b = consistent under Ho and Ha; obtained from xtreg; B = inconsistent under Ha, efficient under Ho; obtained from xtreg. Test: Ho: difference in coefficients not systematic $\chi^2(1) = (b-B)'[(V_b-V_B)^{-1}](b-B) = 1.12$ Prob > $\chi^2 = 0.2909$ (V_b-V_B is not definitely positive).

The null hypothesis was accepted according to Table 5. Therefore, results showed that REM model would be more effective.

Table 512: Random Effects Panel Data Model

| Variable | Coefficient | | P |
|----------|-------------|----------|----------|
| FV | .0016207 | | 0.000*** |
| Constant | 31397.19 | | 0.000*** |
| F prob. | 0.000 | R square | 0,61 |

*, **, *** denote rejection of the null hypothesis at the 10%, 5%, and 1% levels, respectively.

The model is statistically significant and the coefficients of football player value are statistically significant at 10%, 5%, and 1% confidence levels, respectively. Through the research we found that the increase of 1% in football market value will lead same amount rise in growth. As a result of our regression, football player market value has a positive impact on economic growth.

5. CONCLUSIONS

The objective of the study was to investigate whether growth was affected by football market value in the EU-9 countries plus Russia and Turkey during the period 2008–2016. We also aimed at measuring the size and direction of the effects of the football market value variables on economic growth by using panel data analysis. The REM estimation of the model has shown that the coefficient of the independent variable is positive and statistically significant.

In the light of our findings, policies aiming at the improvements in football market value contribute to the increase in economic growth. In a country that more football player is traded and invested may attract more fans and commercial activities transforming profit in the long run. Buying foreign players from overseas clubs or increasing football player transfer value may accelerate added the *value* of football market in this country.

REFERENCES

- Ahlert, G. (2001), "The Economic Effects of the Soccer World Cup 2006 in Germany with Regard to Different Financing", *Economic Systems Research*, 13 (1): 109-127.
- Allmers, Swantje and Maennig Wolfgang (2009), "Economic impacts of the FIFA Soccer World Cups in France 1998, Germany 2006, and outlook for South Africa 2010", *Eastern Economic Journal*, 35: 500–519.
- Boettcher, W. & Hobkinson R. "FIFA World Cup 2014: Brazilian Goals", *colliers.com* (22.02.2018) Chadwick, S. & Arthur, D. (2010), *International Cases in the Business of Sport*, Elsevier Limited, USA
- Conejo, Rosa & Baños-Pino, José & Canal Domínguez, Juan & Rodríguez, Plácido. (2007). "The economic impact of football on the regional economy", *International Journal of Sport Management and Marketing*, 2. 10.1504/IJSMM.2007.013961.
- Consultancy.uk (2018), Premier League and clubs add 3.4 billion to UK economy <https://www.consultancy.uk/news/2946/premier-league-and-clubs-add-34-billion-to-uk-economy> (03.02.2018)
- Deloitte-uk (2017), Annual Review of Football Finance, [deloitte-uk-annual-review-of-football-finance-2017%20\(1\).pdf](https://www.deloitte.com/uk/en/sectors/financial-services/annual-review-of-football-finance-2017%20(1).pdf)
- Hossfeld, O. (2010), Equilibrium Real Effective Exchange Rates and Real Exchange Rate Misalignments: Time Series vs. Panel Estimates, www.infer-research.net
- Johnstone, S., A. Southern, and R. Taylor (2000). "The Midweek Match: Premiership Football and the Urban Economy." *Local Economy*, 15(3): 198–213.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Kapellner, E. & Kostolny J. (2014), Macroeconomics and European club football, Ms Thesis, Lund University, Sweden

kpmg.es (2015). Socioeconomic impact of professional football in Spain, <https://home.kpmg.com/content/dam/kpmg/pdf/2015/07/socioeconomic-impact-professional-football.pdf>

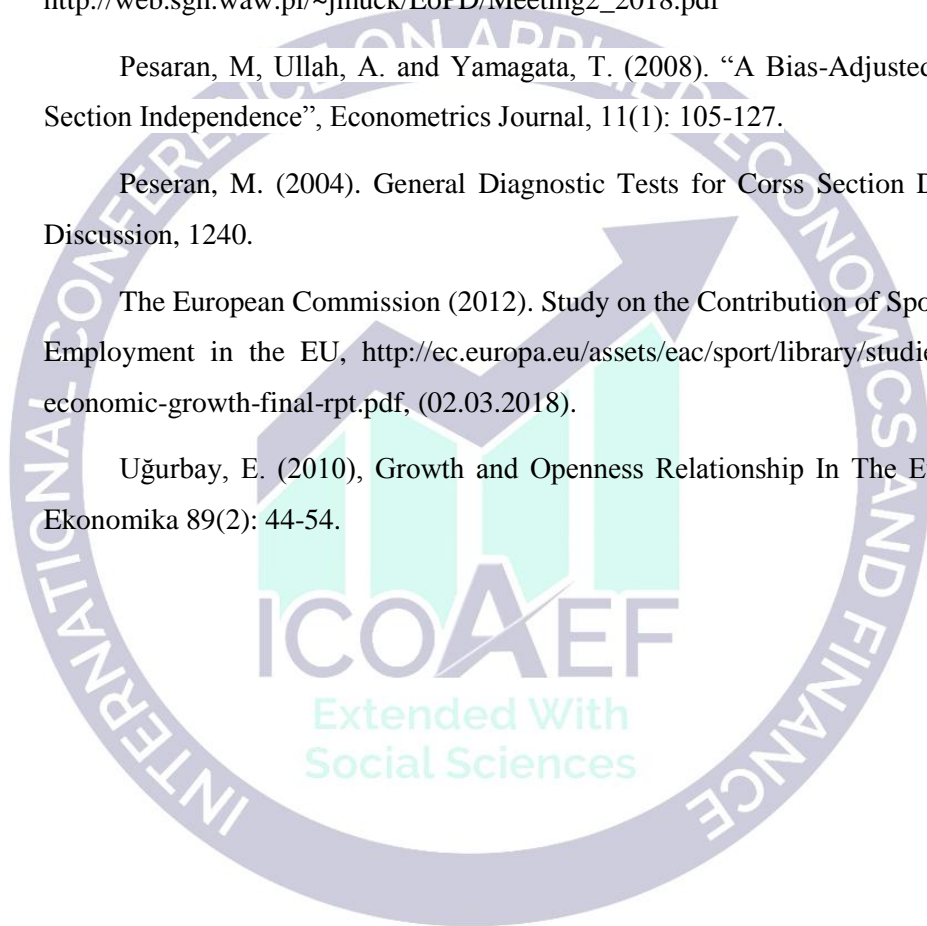
Mućk, Jakub (2018), Econometrics of Panel Data, http://web.sgh.waw.pl/~jmuck/EoPD/Meeting2_2018.pdf

Pesaran, M, Ullah, A. and Yamagata, T. (2008). “A Bias-Adjusted LM Test Of Error Cross-Section Independence”, *Econometrics Journal*, 11(1): 105-127.

Pesaran, M. (2004). General Diagnostic Tests for Corss Section Dependence in Panels. IZA Discussion, 1240.

The European Commission (2012). Study on the Contribution of Sport to Economic Growth and Employment in the EU, <http://ec.europa.eu/assets/eac/sport/library/studies/study-contribution-sports-economic-growth-final-rpt.pdf>, (02.03.2018).

Uğurbay, E. (2010), Growth and Openness Relationship In The Eu-15: Panel Data Analysis, *Ekonomika* 89(2): 44-54.



**DEVLETİN NİHAİ TÜKETİM HARCAMALARI VE İŞSİZLİK ARASINDAKİ
NEDENSELLİK İLİŞKİSİ: TÜRKİYE İÇİN BİR ANALİZ**

Dr. Öğr. Üyesi Mehmet BÖLÜKBAŞ *

ÖZET

Kamu büyüklüğünde meydana gelen değişimlerden işsizlik olgusunun etkilendiği bilinmektedir. Ancak bu etkinin nedenleri ve yönü konusunda bir fikir birliğinden bahsedilememektedir. Bu kapsamda çalışmada Türkiye'de kamu büyüklüğü ile işsizlik arasındaki nedensellik ilişkisi 2005-2018 dönemi dikkate alınarak incelenmiştir. Çalışmada kamu büyüklüğünü temsil etmek üzere devletin nihai tüketim harcamaları değişkeni kullanılmıştır. Elde edilen bulgulara göre, Türkiye ekonomisinde belirtilen dönemde devletin nihai tüketim harcamalarından işsizliğe doğru tek yönlü nedensellik ilişkisi mevcuttur.

***Anahtar Kelimeler:** Kamu harcamaları, İşsizlik, Türkiye, Nedensellik testi.*

***JEL Sınıflandırması:** H50, E24, O53, C10.*

**THE CAUSALITY RELATIONSHIP BETWEEN GOVERNMENT FINAL CONSUMPTION
EXPENDITURES AND UNEMPLOYMENT: AN ANALYSIS FOR TURKEY**

ABSTRACT

It is known that the phenomenon of unemployment is affected by the changes in size of public sector. However, there is no consensus on the reasons and direction of this effect. In this context, the relationship between unemployment and the size of the public sector were examined in Turkey by considering the 2005-2018 periods. In the study, government final consumption expenditures variable was used to represent the size of public sector. According to the findings, there is a unidirectional causality relationship from government final consumption expenditures to unemployment in Turkey's economy during the 2005-2018 periods.

***Keywords:** Government expenditures, Unemployment, Turkey, Causality test.*

***JEL Classification:** H50, E24, O53, C10.*

* Aydın Adnan Menderes Üniversitesi, Aydın İktisat Fakültesi, İktisat Bölümü, Aydın, Türkiye, e-mail: mbolukbas@adu.edu.tr

1. GİRİŞ

Günümüz ekonomilerinin en önemli amaçlarından biri toplumun refah düzeyini artırmak için çeşitli politikalar üretmektir. Bu politikaların oluşumunda kamu büyüklüğünün ne olacağı sorusu da bu bağlamda önem arz etmektedir. Artan toplum ihtiyaçlarının giderilmesi konusunda kamu harcamalarının payı azımsanmayacak düzeyde olduğu için kamu harcamaları ile yapılacak bir müdahale refah düzeyinin iyileşmesine katkı sağlayabilmektedir.

Bu açıdan bakıldığında kamu harcamalarının fiyat istikrarı ve ekonominin genel istikrarı üzerinde etkili olduğu söylenebilmektedir. Ancak bu etkiler hem ülkelerin ekonomik yapısına göre, hem de kamu harcamalarının ne şekilde yapıldığına, nasıl düzenlendiğine ya da neye göre planlandığına göre değişmektedir. Kamu harcamalarının işsizlik üzerindeki etkisi de literatürde sıklıkla tartışılmaktadır. Bu etkinin yönü konusunda Klasik yaklaşımın ve Keynesyen yaklaşımın birbirinden ayrışmasının yanı sıra kamu harcamalarının türü de belirleyici faktör olabilmektedir. Örneğin işsizliğin yüksek olduğu bir dönemde devlet cari harcamalara ağırlık vererek toplam talep düzeyinin artışı sağlamaya çalışarak işsizliği önleyebilmekte, bazen de yapılan bir kamu harcaması özel sektörde dışlama etkisi yarattığı için işsizlik oranları artış gösterebilmektedir. Bununla birlikte artan kamu harcamalarının vergi ve vergi benzeri gelirler ile karşılanması vergilerde artışı da beraberinde getirmekte ve bu durumda piyasada olumsuz etki yaratarak işsizlik düzeyinin yükselmesine yol açabilmektedir.

Kamu büyüklüğü ve işsizlik konusunda Abrams (1999) tarafından yapılan çalışma öncü çalışma olarak nitelendirilebilir. Kamu harcamaları ve işsizlik arasındaki ilişkiyi pek çok nedene dayandıran Abrams, esas olarak artan işsizliğin nedenini kamu sektörünün ekonomideki yükselen rolüne dayandırmaktadır. Bu kapsamda çalışmanın konusu kamu büyüklüğünün işsizlik ile nedensellik ilişkisini Türkiye ekonomisi için araştırmaktır. Kamu büyüklüğünü temsil etmesi için çalışmada devletin nihai tüketim harcamaları kullanılmış olup, işsizlik ile arasındaki nedensellik ilişkisi test edilmiştir. Çalışmanın bundan sonraki kısmı iki bölümden oluşmaktadır. İlk olarak konuya dair literatür taraması Türkiye ekonomisi özelinde ele alınmış, ardından Türkiye ekonomisi verileri ile ekonometrik bir analiz yapılmıştır.

2.KONUYA YÖNELİK LİTERATÜR TARAMASI

Kamu büyüklüğünün istihdam ya da işsizlik ile ilişkisini inceleyen çalışmalara ulusal ve uluslararası literatürde sıklıkla rastlanmaktadır. Bu çalışmalardan bir kısmı, cari harcamalar, yatırım harcamaları, transfer harcamaları gibi tüm kamu harcamalarının istihdam ya da işsizlik üzerindeki etkisini incelerken, bir kısmı da bu harcamaları tek tek ele almakta ve istihdam ya da işsizlik ile ilişkisine odaklanmaktadır. Bu çalışmada Türkiye ekonomisi analizi yapıldığı için özellikle Türkiye ekonomisini inceleyen çalışmalar literatür taraması kapsamına dahil edilmiştir. Azımsanmayacak ölçüde bulunan bu çalışmalardan bazıları şu şekildedir;

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Türkiye’de askeri harcamalar ve istihdam arasındaki ilişkiyi 1950-1997 dönemini dikkate alarak ve ARDL modelini kullanarak çalışmalarını tamamlayan Yıldırım ve Sezgin (2001), Türkiye’de askeri harcamaların istihdam düzeyini negatif yönde etkilediğini belirtmişlerdir.

Türkiye’de kamu harcamalarının pek çok makroekonomik değişkenle nedensellik ilişkisini incelediği çalışmasında Bakırtaş (2003) ise, kamu harcamalarından istihdam düzeyine doğru bir model oluşturmuş ve kamu harcamalarının istihdam düzeyini etkilediği sonucunu bulmuştur. Ancak yazar modeli istihdam düzeyinden kamu harcamalarına doğru oluşturduğunda herhangi bir nedensellik olmadığını ifade etmiştir.

Diğer yandan Şahin ve Özenç (2007), Türkiye ekonomisini 1988-2006 dönemini ele alarak incelemiş ve yapmış olduğu Granger nedensellik testi sonucunda kamu harcamaları ve işsizlik arasında herhangi bir nedensellik ilişkisi olmadığını belirtmiştir.

Akan ve Arslan’ın (2008) çalışmasında ise teşvik yatırımları ve istihdam arasındaki ilişki regresyon analizi ile incelenmiştir. Analiz sonunda elde edilen bulgular, Türkiye’nin Doğu Anadolu Bölgesinde uygulanan teşvik yatırımları ile istihdam arasında doğrusal bir ilişkinin olduğunu ve yatırımların yeni iş imkânları ortaya çıkardığını göstermektedir.

2000-2007 dönemini ele alarak Türkiye’de kamu sektörü büyüklüğünün eğitim seviyesine göre işsizlik oranlarını nasıl etkilediğini inceleyen Aslan ve Kula (2010), çalışmalarının sonucunda kamu sektörü büyüklüğünün işsizliği azalttığı sonucuna ulaşmışlardır. Bununla birlikte çalışmada kamu sektörü büyüklüğünden genel lise mezunu ve lise dengi meslek okul mezunu işsizlik oranına doğru tek yönlü nedensellik ilişkisi elde edilmiştir.

Türkiye ekonomisi için 1980-2008 dönemi verilerini kullanarak ekonometrik bir analiz yapan Yavuz (2010) da çalışmasında yatırım ve istihdam arasındaki ilişkiye odaklanmış ve yatırım teşviklerinin istihdam düzeyini olumlu yönde etkilediğini tespit etmiştir.

Kaya, Kaygısız ve Altuntepe (2015), 1990-2013 dönemi verileri ile cari, yatırım ve transfer harcamaları ile istihdam arasındaki ilişkiyi Türkiye ekonomisi için incelemişler ve kamu harcamalarından istihdamda doğru herhangi bir nedenselliğin olmadığını gözlemlemişlerdir. Ancak buna karşılık yapılan analizde istihdamdan cari harcamalara doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi olduğu ve özel sektör yatırım harcamalarının toplam istihdamı pozitif yönde etkilediği belirtilmiştir.

Son dönemde yapılan çalışmalardan biri olan Kanca ve Bayrak’ın (2015) çalışmasında da 1980-2013 dönemini ele alınmış ve Türkiye’de kamu harcama bileşenleri ile işsizlik arasındaki ilişki incelenmek istenmiştir. Çalışmanın sonucunda, transfer harcamaları ile işsizlik düzeyi arasında çift yönlü, cari ve yatırım harcamaları ile işsizlik düzeyi arasında ise ters yönlü bir ilişki elde edilmiştir.

Kamu yatırım harcamalarının işgücü piyasası üzerindeki etkilerini Türkiye’de Batı ve Doğu Karadeniz Bölgesi için araştıran Sancar, Sancar ve Polat (2016) ise, analizleri sonucunda kamu yatırım harcamalarının bölgesel kalkınmanın göstergesi olarak belirtilen bölgelerin istihdam hacminde beklendiği gibi bir değişiklik oluşturmadığını izlenmişlerdir.

Son olarak Bayrakdar (2017), kamu büyüklüğünün işsizlik üzerindeki etkisini teorik olarak incelemiş ve genel kabulün aksine kamu harcamalarının her koşulda işsizliği azaltma noktasında pozitif etkisinin beklendiği gibi olmayabileceğini, dışlama etkisi ortaya çıkarabileceğini vurgulamıştır. Ayrıca çalışmada artan kamu harcamalarının emek vergisini artıracığına, bu durumun da emek talebini azaltarak işsizliğe yol açabileceğine değinilmiştir.

Türkiye ekonomisini ele alarak analizlerini tamamlayan çalışmalarda görüldüğü üzere kamu sektörü harcamalarının istihdam ve işsizlik üzerinde etkisi konusunda bir fikir birliğinden bahsedilememektedir. Ele alınan çalışmalarda kullanılan yöntem farklılıkları ve dönem farklılıkları çalışmaları özgün kılmakta ve literatüre yeni katkılar sağlamaktadır. Bu çalışmada ise diğerlerinden farklı olarak 2005-2018 dönemi ele alınarak 2005 sonrası dönemde devletin nihai tüketim harcamaları ve işsizlik oranı arasındaki nedensellik ilişkisini incelenmek istenmiştir. Bu kapsamda çalışmanın bundan sonraki aşamasında ekonometrik analize yer verilmiştir.

3. TÜRKİYE VERİLERİ İLE EKONOMETRİK ANALİZ

Çalışmanın bu kısmında Türkiye verileri kullanılarak devletin nihai tüketim harcamaları ve işsizlik arasındaki nedensellik ilişkisi ekonometrik analizler yardımıyla incelenmiştir. Bu kapsamda ilk olarak çalışmanın veri seti ve modeli tanımlanmış, ardından ön testlere yer verilmiştir. Değişkenler arasındaki nedensellik ilişkilerini tespit etmek için Granger (1969) nedensellik testi kullanılmıştır. Bu çalışmada devletin nihai tüketim harcamaları ve işsizlik arasındaki nedensellik ilişkisini tespit etmek için 2005:Q1-2018:Q1 dönemi verileri kullanılmıştır. Çalışmanın veri seti TCMB (29.04.2018) Elektronik Veri Dağıtım Sistemi’nden ve TÜİK’ten (29.04.2018) elde edilmiş olup, devletin nihai tüketim harcamaları ve işsizlik oranları kullanılmıştır. Çalışmanın veri seti aşağıda yer alan tabloda daha açık görülmektedir.

Tablo 1. Çalışmanın Veri Seti

| Değişkenler | Kısaltması | Açıklaması | Kaynağı |
|------------------------------------|-------------------|--|----------------|
| İşsizlik | IS | İşsizlik oranı (%) | TÜİK (2018) |
| Devletin nihai tüketim harcamaları | TH | Devletin nihai tüketim harcamaları oranı (%) | TCMB (2018) |

Çalışmanın modeli oluşturulurken Abrams'ın (1999) çalışması referans alınmıştır. Literatürde Abrams Eğrisi olarak da bilinen yaklaşımda Abrams (1999) kamu sektörünün büyüklüğünü işsizlik ile ilişkilendirmekte ve bu iki değişken arasında bir ilişki olduğunu ileri sürmektedir. Bu yaklaşımdan hareketle çalışmada kamu sektörünün büyüklüğünü temsilen devletin nihai tüketim harcamaları bağımsız değişken olarak, işsizlik oranı ise bağımlı değişken olarak belirlenmiştir. Aşağıda yer alan (1) numaralı denklem çalışmada kullanılan modeli ifade etmektedir.

$$IS_t = \beta_0 + \beta_1 TH_t + U_t \quad (1)$$

Bu denklikte yer alan IS, işsizlik oranını, TH devletin nihai tüketim harcamalarını, U_t hata terimini, β 'lar katsayıyı, değişkenlerin altında yer alan t indisi ise değişkenlerin zaman serisi olduğunu ifade etmektedir. Bu model yardımıyla değişkenler arasındaki nedensellik ilişkisi incelenmek istenmiş ve bunun için Granger (1969) nedensellik testi uygulanmıştır. Ancak nedensellik testlerine geçmeden önce bazı ön testlere ve sonuçlarına yer verilmiştir.

3.1. Ön Testler

Nedensellik testlerine geçmeden önce ilk olarak serilerde mevsimsellik araştırması gerçekleştirilmiş ancak mevsimsellik sorununa rastlanmadığı için mevsimsellikten arındırma işlemi yapılmamıştır. Daha sonra, değişkenlerin durağanlık düzeyleri Phillips-Perron (PP) ve Kwiatkowski-Phillips-Schmidt-Shin (KPSS) birim kök testleri kullanılarak araştırılmıştır. Çalışmalarda genellikle Dickey-Fuller (DF) ve Augmented Dickey-Fuller (ADF) birim kök testlerine başvurulmaktadır. PP testi ise DF ve ADF birim kök testlerine getirilen bir takım eleştiriler sonucu ortaya çıkmış olup, varsayımları açısından DF ve ADF testlerinden daha esnektir. Bu birim kök testlerinin daha iyi anlaşılabilmesi için aşağıda yer alan (2) ve (3) numaralı denklemler incelenebilir (Tari, 2015: 400);

$$Y_t = a_0 + a_1 y_{t-1} + U_t \quad 2)$$

$$Y_t = a_0 + a_1 y_{t-1} + a_2 \left(t - \frac{T}{2}\right) + U_t \quad 3)$$

Denklemden yer alan T gözlem sayısını, U_t ise hata terimini ifade etmektedir. Normal şartlar altında hata teriminin beklenen değeri sifıra eşittir. Burada hata terimleri arasında içsel bağıntının olmadığı varsayımı ya da homojenlik varsayımı gerekli görülmemektedir. Bu nedenle DF testinde yer alan bağımsızlık ve homojenite varsayımlarının PP testinde terk edildiği, hata terimlerinin zayıf bağımlılığı ve heterojen dağılımlı olduğu kabul edilmektedir. Bu açıdan bakıldığında PP testinde, DF t istatistiklerinin geliştirilmesinde hata terimlerinin varsayımları konusundaki sınırlamalarının dikkate

alınmadığı söylenebilmektedir (Tarı, 2015: 400). PP testinin hipotezleri ADF testinin hipotezleri ile aynı olup şu şekilde ifade edilmektedir;

H_0 : $p=0$ Seride birim kök sorunu vardır, durağan değildir.

H_1 : $p<0$ Seride birim kök sorunu yoktur, durağandır.

DF ve ADF testinde olduğu gibi PP testinde de H_0 hipotezi H_1 hipotezine karşılık test edilmekte ve testten elde edilen PP test istatistiği MacKinnon (1996) kritik değerleri ile kıyaslanarak yorumlanmaktadır. PP birim kök testinden farklı olarak KPSS birim kök testi ise ADF ve PP birim kök testlerinin tersi olarak değerlendirmekte ve bu birim kök testlerinin sağlamasını yapan bir test olarak görülmektedir. Kwiatkowski, Phillips, Schmidt ve Shin'e (1992: 162) göre, KPSS birim kök testinin dayandığı denklem (4) numaralı denklemde ifade edilmektedir;

$$y_t = \varepsilon_t + r_t + \varepsilon_t \quad (4)$$

Burada yer alan r rassal terim olarak görülmekte ve (5) numaralı denklemdeki gibi ifade edilmektedir;

$$r_t = r_{t-1} + \sigma_u^2 u_t \quad (5)$$

Bu açıdan bakıldığında KPSS testinde u_t 'nin varyansının (σ_u^2) sıfıra (0) eşit olup olmadığı araştırılmaktadır. Diğer testlerden farklı olarak KPSS birim kök testi ters hipotezlere sahiptir. Dolayısıyla bu testte temel (sıfır) hipotez (H_0) serinin birim kök içermediğini ve durağan olduğunu, alternatif hipotez (H_1) ise seride birim kök olduğunu ve durağan olmadığını göstermektedir. Bu çalışmada kullanılan serilere PP ve KPSS birim kök testleri uygulanmış ve sonuçları Tablo 2 ve 3'deki gibi çıkmıştır.

Tablo 2. PP Birim Kök Test Sonuçları

| | | TH | IS |
|------------------|----------------------|----------|----------|
| | İstatistik Değerleri | -3.271** | -3.097** |
| MacKinnon (1996) | %5 | -2.918 | -2.918 |
| Kritik Değerler | %10 | -2.597 | -2.597 |

Not: Test biçimi olarak düzey değerde sabit terimli regresyon denklemi kurulmuştur. ** %5 seviyesinde durağanlığı ifade etmektedir.

Tablo 3. KPSS Birim Kök Test Sonuçları

| | | TH | IS |
|----------------------|-----|---------|---------|
| İstatistik Değerleri | | 0.251** | 0.097** |
| KPSS (1992) | %5 | 0.463 | 0.463 |
| Kritik Değerler | %10 | 0.347 | 0.347 |

Not: Test biçimi olarak düzey değerde sabit terimli regresyon denklemi kurulmuştur. ** %5 seviyesinde durağanlığı ifade etmektedir.

Tablo 2 ve 3'den izlenebileceği gibi TH ve IS değişkenleri %5 anlamlılık düzeyinde düzeyde durağan görünmektedir. Bu durum serilerde birim kök sorununun olmadığını ifade etmesi açısından önemlidir. Dolayısıyla bu sonuca dayanarak modelde serilerin düzey değerlerinin [I(0)] kullanılmasına karar verilmiştir. Serilerde birim kök sınavının ardından nedensellik testleri için gerekli olan uygun gecikme uzunluğunun belirlenmesi aşamasına geçilmiştir. Uygun gecikme uzunluğunun belirlenmesi için genellikle Son Tahmin Hatası Kriteri (Final prediction error-FPE), Akaike Bilgi Kriteri (Akaike Information Criterion-AIC), Schwarz Bilgi Kriteri (Schwarz Information Criterion-SC) ve Hannan-Quinn Bilgi Kriteri (Hannan-Quinn Information Criterion-HQ) kullanılmaktadır (Johansen, 1995; Enders, 1995). Aşağıda yer alan tabloda FPE, AIC, SC ve HQ'ye göre uygun gecikmeler görülmektedir.

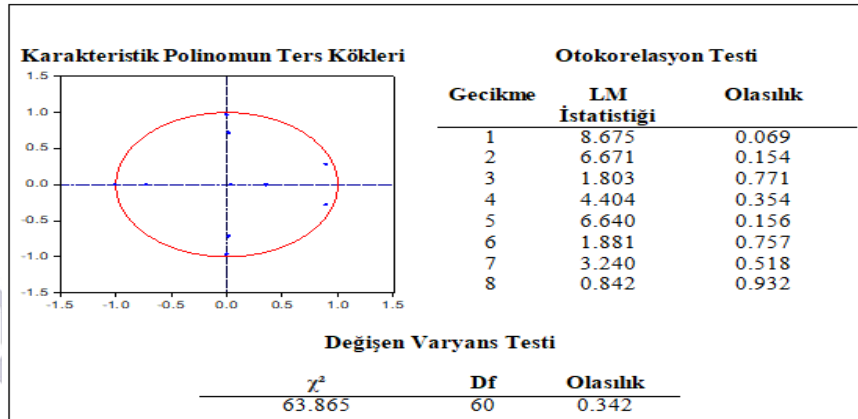
Tablo 4. Uygun Gecikme Uzunluğunun Belirlenmesi

| Gecikme | FPE | AIC | SC | HQ |
|---------|----------|----------|----------|----------|
| 0 | 413.7946 | 11.70111 | 11.78141 | 11.73104 |
| 1 | 72.21146 | 9.954957 | 10.19585 | 10.04476 |
| 2 | 76.82873 | 10.01549 | 10.41697 | 10.16516 |

| | | | | |
|----------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 3 | 27.51276 | 8.985311 | 9.547384 | 9.194846 |
| 4 | 29.19114 | 9.038689 | 9.761354 | 9.308092 |
| | 18.20083* | 8.557017* | | 8.886286* |
| 5 | | | 9.440274* | |
| 6 | 19.39070 | 8.606689 | 9.650539 | 8.995826 |
| 7 | 21.99721 | 8.713709 | 9.918151 | 9.162713 |
| 8 | 21.66193 | 8.672562 | 10.03760 | 9.181433 |

Tüm bilgi kriterlerine bakıldığında beşinci gecikme uzunluğunun uygun gecikme olduğu anlaşılmaktadır. Bu gecikme uzunluğunun gerçekten en uygun gecikme olup olmadığının belirlenmesi için doğrulama testleri de yapılmış ve sonuçları şu şekilde çıkmıştır;

Tablo 5. Gecikme Uzunluğu Doğrulama Testleri



Doğrulama testlerinden görüleceği gibi seçilen uygun gecikme uzunluğu söz konusu model için gerçekten uygun bir gecikmedir. Çünkü seçilen gecikme uzunluğunda otokorelasyon ve değişen varyans sorunu görülmemektedir. Otokorelasyonun varlığı LM testi yardımıyla, değişen varyansın olup olmadığı ise White testi ile araştırılmış ve olasılık değerlerinin 0.05'den büyük çıktığı görülmüştür. Bu sonuç seçilen gecikme uzunluğunda otokorelasyon ve değişen varyans sorununun olmadığını göstermektedir. Aynı zamanda karakteristik polinomun ters kökleri birim çember içinde kalmaktadır. Lütkepohl (1991), bu şekilde olan bir VAR modelinin durağan bir sürece sahip olduğunu, etki-tepki fonksiyonları, standart hata ve benzeri sonuçlar bakımından güvenli olduğunu ifade etmektedir. Sonuç olarak beş gecikmeli VAR modeli, doğrulama testleri açısından etkin ve tutarlıdır.

3.2. Granger Nedensellik Testi ve Bulgular

Ekonometrik analizlerde sıklıkla kullanılan regresyon denklemleri bağımlı ve bağımsız değişken(ler) arasındaki ilişkiler hakkında bilgi vermektedir. Ancak bu ilişki her zaman bir nedensellik ilişkisi olduğunu ifade etmemektedir. Bu kapsamda Granger (1969), nedensellik testlerini önererek X ve Y gibi iki değişkenden birinin sebep diğerinin sonuç olabileceğini belirtmiştir. Granger (1969) ile başlayan nedensellik testleri halen geliştirilmeye devam etmekte ve ilgili literatüre önemli katkılar sunulmaktadır. Granger (1969) nedensellik testine göre, X ve Y değişkenlerinin kullanıldığı bir modelde, eğer X değişkenine ait bilgilerin modele dâhil edilmesi, Y değişkeninin öngörüsüne katkı sağlıyorsa, X değişkeni, Y değişkeninin nedeni olarak tanımlanmakta ve “nedenselliğin yönünün X değişkeninden Y değişkenine doğru olduğu” kabul edilmektedir. Devletin nihai tüketim harcamaları (TH) ve işsizlik (IS) örneğinde Granger nedensellik testi (6) ve (7) numaralı denklemler kullanılarak yapılabilir;

$$IS_t = a_0 + \sum_{i=1}^m a_i IS_{t-i} + \sum_{i=1}^m b_i TH_{t-i} + u_i \quad (6)$$

$$TH_t = a_0 + \sum_{i=1}^m a_i TH_{t-i} + \sum_{i=1}^m b_i IS_{t-i} + u_i \quad (7)$$

Bu denklikten yola çıkılarak test edilen temel hipotez $\sum_{i=1}^m b_i = 0$ şeklinde tanımlanır ve bu hipotez TH'dan IS'ye nedensellik olmadığını (benzer şekilde ikinci denklemin test edilen hipotezi de IS'den TH'ya nedensellik olmadığını) ifade etmektedir. Bu temel hipotezinin alternatifi de $\sum_{i=1}^m b_i \neq 0$ olarak gösterilir ve bu hipotez de TH'dan IS'ye nedensellik olduğunu (benzer şekilde ikinci denklemin test edilen alternatif hipotezi de IS'den TH'ya nedensellik olduğunu) belirtmektedir. Granger nedensellik testinde serilerin durağan olma ve eşbütünleşme ilişkisine sahip olma şartı aranmaktadır. Çalışmanın daha önceki kısımlarında yapılan ön testlerde serilerin düzeyde durağan olduğu belirtilmişti. Granger nedensellik testine başlamadan önce seriler arasındaki eşbütünleşme ilişkisi de araştırılmış ve eşbütünleşik olduğu anlaşılan seriler Granger nedensellik testi ile analiz edilmiştir. Granger nedensellik testinin sonuçları Tablo 6'da sunulmuştur.

Tablo 6. Granger Nedensellik Testi ve Bulgular

| Temel hipotez | Gözlem Sayısı | F - İstatistik | Olasılık | Karar |
|------------------------------------|---------------|----------------|----------|------------------|
| TH, IS'nin Granger nedeni değildir | 48 | 2.015 | 0.099 | Nedensellik var. |

| | | | | |
|---------------------------------------|----|-------|-------|------------------|
| IS, TH'nin Granger nedeni değildir | 48 | 1.334 | 0.271 | Nedensellik yok. |
|---------------------------------------|----|-------|-------|------------------|

Granger Nedensellik Testi sonuçlarının sunulduğu Tablo 6'ya göre devletin nihai tüketim harcamaları işsizliğin Granger nedeni iken, işsizlik devletin nihai tüketim harcamalarının Granger nedeni değildir. Dolayısıyla %10 anlamlılık düzeyinde de olsa devletin nihai tüketim harcamalarından işsizliğe doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisinden bahsedilebilir. Kamu harcamaları ve işsizlik arasındaki teorik ilişkiyle uyumlu olan bu sonuç aynı zamanda belirtilen dönemde devletin nihai tüketim harcamalarındaki gelişmelerin işsizlik sorunu ile ilişkili olduğunu göstermesi açısından önemlidir.

4.SONUÇ

Türkiye'de işsizlik konusunun en önemli makroekonomik problemlerden biri olarak görülmesi bu alanda yapılan çalışmaların artmasına ve elde edilen bulguların farklılaşmasına yol açmaktadır. İşsizlik konusunu kamu büyüklüğü ile ilişkilendiren pek çok çalışmaya literatürde rastlanmaktadır. Bu çalışmaların bir kısmı kamu büyüklüğündeki artışla birlikte işsizlik oranlarının iyileşeceğini ifade etmekte, bir kısmı da beklenenin aksine kamu büyüklüğünün artmasının işsizliği beraberinde getireceğini savunmaktadır. Bu çalışmada ise ekonomide kamu büyüklüğünü temsil eden değişkenlerden biri olan devletin nihai tüketim harcamalarının işsizlik ile nedensellik ilişkisi Türkiye ekonomisi için araştırılmaktadır. Diğer çalışmalardan farklı olarak bu çalışmada 2005 sonrası dönem ele alınarak yakın dönem analizi yapılmak istenmiştir. Granger nedensellik testinin yapıldığı analiz sonucunda elde edilen bulgular, Türkiye'de 2005-2018 döneminde devletin nihai tüketim harcamalarından işsizliğe doğru tek yönlü nedensellik olduğunu göstermektedir. Türkiye ekonomisi için önemli olan bu bulgu, devlet tarafından yapılan tüketim harcamalarının işsizliğin bir nedeni olduğunu göstermektedir. Bu bulgudan hareketle oluşturulacak olan makroekonomik politikalarda, özellikle kamu harcama politikalarında ihtiyatlı davranılması gerektiği söylenebilmektedir. Diğer yandan bu çalışmanın kısıtı kamu büyüklüğünü temsil etmek üzere sadece devletin nihai tüketim harcamalarının kullanılmasıdır. Kamu yatırım harcamalarının ya da transfer harcamalarının da modele dâhil edilerek işsizlik üzerindeki etkisinin incelenmesi kamu büyüklüğü ve işsizlik arasındaki nedensellik ilişkisinin yönü konusunda yeni ve daha güçlü bulguların ortaya çıkmasını sağlayacaktır.

KAYNAKÇA

Abrams, B. A. (1999), "The Effect of Government Size on the Unemployment Rate", *Public Choice*, 99(3/4): 395-401.

Akan, Y. ve Arslan, İ. (2008) "Türkiye'de Sektörel Yatırım Teşvik Belgeleri ile İstihdam Analizi: Doğu Anadolu Bölgesi Üzerine Bir Uygulama (1980-2006)", *Çalışma ve Toplum*, 1: 107-119.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Aslan, A. Ve Kula, F. (2010) “Kamu Sektör Büyüklüğü-İşsizlik İlişkisi: Abrams Eğrisi'nin Türkiye Ekonomisi İçin Testi”, Maliye Dergisi, 159: 155-166.
- Bakırtaş, İ. (2003) “Kamu Harcamalarının Temel Makroekonomik Göstergelerle İlişkisi ve Nedenselliği (1983-2000 Türkiye Örneği)”, Dumlupınar Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 9: 41-66.
- Bayraktar, S. (2017) “Kamu Büyüklüğünün İşsizlik Üzerine Etkisi: Teorik Bir İnceleme”, Çalışma İlişkileri Dergisi, 8(2): 95-117.
- Enders, W. (1995) “Applied Econometric Time Series”, John Willey and Song, Inc. 4th edition, Wiley Series in Probability and Statistics.
- Granger, C. W. J. (1969) “Investigating Causal Relations by Econometric Models and Cross-Spectral Methods”, Econometrica, 37: 424-438.
- Johansen, S. (1995) “Likelihood Based Inference in Cointegrated Vector Autoregressive Models”, Oxford University Press, New York.
- Kanca, O. C. Ve Bayrak, M. (2015) “Kamu Harcamaları Bileşenleri İle İşsizlik Arasındaki İlişki (Türkiye Örneği)”, Gazi İktisat ve İşletme Dergisi, 1(2): 55-74.
- Kaya, G. D., Kaygısız D. A. ve Altuntepe, N. (2015) “Türkiye’de Kamu Harcamalarının Toplam İstihdama Etkisi Üzerine Bir Değerlendirme”, AKÜ İİBF Dergisi XVII(1): 83-96.
- Kwiatkowski, D. Phillips, P. C. B. Schmidt, P. ve Shin, Y. (1992) “Testing The Null Hypothesis of Stationarity Against The Alternative of a Unit Root”, Journal of Econometrics, 54: 159-178.
- Lütkepohl, H. (1991) “Introduction to Multiple Time Series Analysis”, Springer-Verlag, Berlin.
- MacKinnon, J. G. (1996) “Numerical Distribution Functions for Unit Root and Cointegration Tests”, Journal of Applied Econometrics, 11(6): 601-618.
- Sancar, C., Sancar, C. ve Polat, A. M. (2016) “Kamu Yatırım Harcamaları İstihdam Düzeyini Etkiler Mi? (TR 8 ve TR 9 Düzey 1 Bölgeleri İçin Bir Uygulama)”, Uluslararası Sosyal Araştırmalar Dergisi, 9(43): 2122-2133.
- Şahin, M. ve Özenç, Ç. (2007) “Kamu Harcamaları ile Makro Ekonomik Değişkenler Arasındaki Nedensellik İlişkileri”, Yönetim Bilimleri Dergisi, 5 (2): 200-225.
- Tarı, R. (2015) “Ekonometri”, Kocaeli: Umuttepe Yayınları.
- TCMB (2018) “Elektronik Veri Dağıtım Sistemi”, <https://evds2.tcmb.gov.tr/index.php?/evds/serieMarket> (29.04.2018).
- TÜİK (2018) “İstatistik Göstergeler” <http://www.tuik.gov.tr/UstMenu.do?metod=istgosterge> (29.04.2018).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Yavuz, A. (2010) “Bir Maliye Politikası Aracı Olarak Yatırım Teşviklerinin Rekabet Koşulları Altında Özel Kesim Yatırımları ve İstihdam Üzerine Etkisi: Ekonometrik Bir Analiz”, Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 15(1): 83-101.

Yıldırım, J. ve Sezgin, S. (2001) “Military Expenditure and Employment in Turkey”, Çukurova Üniversitesi, 8. Ulusal Ekonometri ve İstatistik Sempozyumu, https://www.academia.edu/3993191/Military_expenditure_and_employment_in_Turkey.
27.11.2018



**TÜRKİYE'DE DIŞ TİCARET AÇIĞININ SÜRDÜRÜLEBİLİRLİĞİ ÜZERİNE BİR
UYGULAMA**

Mehmet DAĞ*

Fatma KIZILKAYA**

ÖZET

Dış ticaret açığı, son yıllarda Türkiye ekonomisinin en büyük sorunlarından biri haline gelmiştir. Bu çalışmada 1984:01-2017:04 dönemi aylık veriler kullanılarak ele alınan dönem için Türkiye'de dış ticaret açığının sürdürülebilir olup olmadığı araştırılmıştır. Çalışmada Quintos (1995) tarafından önerilen ve değişkenler arasında eşbütünleşme ilişkisinin test edilmesine dayanan yöntem kullanılmıştır. Seriler arasında eşbütünleşme ilişkisinin varlığı Bayer ve Hanck (2012) eşbütünleşme testi ile sınanmıştır. Eşbütünleşme testi sonucunda seriler arasında eşbütünleşme ilişkisinin var olduğu, yani serilerin uzun dönemde birlikte hareket ettikleri tespit edilmiştir. Uzun dönem eşbütünleşme katsayıları ise DOLS ve FMOLS yöntemleriyle tahmin edilmiştir. Elde edilen sonuçlar Türkiye'de dış ticaret açığının zayıf sürdürülebilir olduğunu göstermektedir.

Anahtar Kelimeler: *Dış ticaret açığı, Sürdürülebilirlik, Eşbütünleşme testi, DOLS, FMOLS*

JEL Kodları: *F4, E6, C22*

AN APPLICATION ON SUSTAINABILITY OF TRADE DEFICIT IN TURKEY

ABSTRACT

In recent years foreign trade deficit has become one of the biggest problems of Turkey. In this study, for the period of 1984: 01-2017: 04 monthly data has been used for the investigation of sustainability of foreign trade. In the study, the method, which was proposed by Quintos (1995) and based on testing the cointegration relationship between variables, was used. The existence of a cointegration relationship between the series was tested by Bayer and Hanck (2012) cointegration test. As a result of the cointegration test, it was determined that there was a cointegration relationship between the series, so the series moved together in the long term. The long-term cointegration

* Dr. Öğr.Üyesi, Siirt Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Maliye Bölümü, Siirt, Türkiye, mehmetdag323@gmail.com

** Öğr.Gör, Hakkâri Üniversitesi Yüksekova Meslek Yüksekokulu, Hakkâri, Türkiye, fatmakizilkaya@hakkari.edu.tr

coefficients were estimated by DOLS and FMOLS methods. The obtained results indicate that foreign trade deficit has weak sustainability in Turkey.

Keywords: *Trade Deficit, Sustainability, Cointegration Test, DOLS, FMOLS*

JEL Codes: *F4, E6, C22*

1. GİRİŞ

Dış ticaret dengesi, günümüzde ülkelerin makroekonomik performanslarının en önemli göstergelerinden biri olarak kabul edilmektedir. Küreselleşme ile birlikte artan dış ticaret hacmi ülkelerin dış ticaret dengelerini etkilemektedir. Dış ticaret dengesindeki bozulmalar döviz kuru rejimini olumsuz yönde etkileyebilmekte ve bunun yanında özellikle gelişmekte olan ülkelere ekonomik büyümenin yavaşlamasına da neden olmaktadır.

Dış ticaret dengesini oluşturan unsurlardan ihracatın ithalatı karşılayamadığı durumlarda dış ticaret açığı ortaya çıkmaktadır. Özellikle Türkiye gibi gelişmekte olan ülkelere yatırımcılar açısından ülkenin ekonomik performansının değerlendirilmesinde dış ticaret açıklarının düzeyi ve sürdürülebilirliği büyük önem taşımaktadır. Türkiye'de özellikle 1980'li yıllardan itibaren ekonominin dışa açılmasına bağlı olarak dış ticaretin önemi ve miktarı artmıştır. İhracat odaklı büyümenin hedef olarak belirlenmiş olmasına rağmen 1980 sonrası dönemde önemli ülke oranda dış ticaret açığı vermeye başlamıştır. Dış ticaret açıkları ekonomide diğer göstergeleri olumsuz yönde etkileyerek finansal açıklara yol açmış ve bunun neticesinde 1990'lı yıllardan itibaren finansal krizler yaşanmıştır. Bu nedenle Türkiye gibi gelişmekte olan ülkelere dış ticaret açıkları ve bu açıkların sürdürülebilirliğine ilişkin çalışmalar son yıllarda artış göstermeye başlamıştır.

Çalışmanın birinci bölümünde konuyla ilgili genel çerçeveye yer verilen giriş bölümü yer almaktadır. İkinci bölümde dış ticaret açıklarını çeşitli boyutlarıyla inceleyen çalışmalarını içeren literatür özetine yer verilmektedir. Çalışmada uygulanan ampirik analize ilişkin model, yöntem ve veri seti çalışmanın üçüncü bölümünü oluşturmaktadır. Dördüncü ve son bölümde yer verilen sonuç ve öneriler kısmı ile çalışma son bulmaktadır.

2. LİTERATÜR ÖZETİ

Literatürde yapılan çalışmalara bakıldığında dış ticaret açığının izlenmesinde ve sürdürülebilirliğinin değerlendirilmesinde temel veri olarak ithalat ve ihracat serilerinin esas alındığı görülmektedir. Dış ticaret açıklarının sürdürülebilirliğine ilişkin yapılan öncü çalışmalarda Husted (1992) tarafından geliştirilen modelin kullanıldığı görülmektedir. Husted (1992), Amerika Birleşik Devletleri (ABD) ekonomisinde cari açığın sürdürülebilirliğini dönemler arası bütçe kısıtı teorisini esas alarak 1967-1989 yılı için incelemiştir. Takip eden yıllardaki çalışmalarda dış ticaret açıklarının

sürdürülebilirliğinin ağırlıklı olarak dönemler arası bütçe kısıtı yaklaşımı çerçevesinde incelendiği görülmektedir. Bahmani-Oskooee (1994), tarafından yapılan çalışmada Avustralya için 1966-1990 dönemi ihracat ve ithalat verilerinden hareketle seriler arasındaki eşbütünleşme ilişkisinin varlığı araştırılmıştır. Çalışmada uygulanan birim kök ve eşbütünleşme analizleri neticesinde serilerin eşbütünleşik olduğundan hareketle dış ticaret açığının uzun dönemde sürdürülebilir olduğu bulgusu ortaya konulmuştur.

Bahmani-Oskooee ve Rhee (1997), Kore ekonomisi ihracat ve ithalat serilerinin eşbütünleşme ilişkisini inceledikleri çalışma neticesinde serilerin uzun dönemde eşbütünleşik olduğunu ve dolayısıyla çalışmada 1963-1991 döneminde dış ticaret açıklarının sürdürülebilir olduğu sonucunu elde etmişlerdir. Arize (2002), 50 ülke için 1973-1998 döneminde Johansen eşbütünleşme analizi kullanarak ihracat ve ithalat verileri üzerinden dış ticaret açığının sürdürülebilirliğini araştırmıştır. Çalışmada dönemler arası bütçe kısıtı yaklaşımı esas alınmış ve 50 ülkenin 35'inde açıkların sürdürülebilir olduğu, diğer bölgelere kıyasla Orta Doğu, Latin Amerika ve Avrupa ülkelerinde dış ticaret açıklarının daha dengesiz bir seyir izlediği bulguları elde edilmiştir. Şili ekonomisi için 1975-2004 döneminde ihracat ve ithalat arasındaki uzun dönem ilişkisiyi ele aldıkları çalışmada Herzer ve Felicitas (2006), birim kök testleri ve eşbütünleşme yöntemini kullanarak bir analiz gerçekleştirmişlerdir. Analiz sonuçları 1982-1983 dönemi haricinde ihracat ve ithalat arasında uzun dönemli bir denge olduğunu işaret etmektedir. Irandoust ve Ericsson (2004), Fransa, Almanya, İtalya, İsveç, İngiltere ve ABD açısından 1971-1997 yılları için dış ticaret dengelerini inceledikleri çalışmada Almanya, İsveç ve ABD için açıkların dış ticaret açıklarının uzun dönemde sürdürülebilir olduğunu, İngiltere için ise sürdürülemez olduğunu ortaya koymuşlardır. Kumar-Narayan ve Narayan (2005), az gelişmiş 22 ülke için ithalat ve ihracat arasında uzun vadeli bir eşbütünleşme olup olmadığını araştırmışlardır. Panel veri analizi kullanılarak yapılan ve 1960-2000 dönemini ele alan ampirik analiz sonuçları ihracat ve ithalatın 22 ülkeden 6'sında eşbütünleşik olduğunu göstermiştir.

Tang (2006), Japonya örneğinde birim kök testlerini kullanarak dış ticaret açıklarının sürdürülebilirliğini incelemiş ve 1975-2004 dönemi için Arize'nin (2002) bulgularından farklı olarak açıkların sürdürülemez olduğu bulgusunu elde etmiştir. Sri Lanka için Perera ve Verma (2008), dış ticaret açıklarının sürdürülebilirliğini ele alan bir çalışma yürütmüşler ve 1950-2006 yılları arasındaki dönemdeki verileri birim kök ve eşbütünleşme testleri ile incelemişlerdir. Çalışma bulguları Sri Lanka için uzun dönemde ihracat ve ithalat arasında bir dengenin bulunmadığını, dolayısıyla dış ticaret açıklarının sürdürülebilir olmadığını göstermiştir. Konya ve Singh (2008), Hindistan ekonomisi için 1949-2005 döneminde dış ticaret dengesini birim kök ve eşbütünleşme analizleriyle incelemişler ve seriler arasında eşbütünleşme ilişkisi bulunmadığı bulgusunu elde etmişlerdir. Çalışma bulguları Hindistan'ın makroekonomik politikalarının ihracat-ithalat dengesini sağlayamadığını ve Hindistan dış

ticaret açıklarının dönemler arası bütçe kısıtını ihlal ettiğini dolayısıyla sürdürülemez olduğunu ortaya koymaktadır.

Pakistan için dış ticaret açıklarının sürdürülebilirliği Mukhtar ve Rasheed (2010), tarafından Johansen eşbütünleşme testi ile analiz edilmiş ve test bulguları 1972-2006 dönemi için Pakistan'da dış ticaret açıklarının sürdürülebilir olduğunu göstermiştir. Güney Afrika için Pillay (2014), tarafından 1985-2012 dönemi verileri kullanılarak yapılan çalışmada ihracat ve ithalat arasında uzun dönemli bir denge bulunmuş ve söz konusu dönemde dış ticaret açıklarının sürdürülebilir olduğunu gösteren bulgulara ulaşılmıştır. Dokuz Orta Doğu ve Kuzey Afrika ülkesi (Cezayir, Mısır, İran, İsrail, Ürdün, Fas, Sudan, Suriye ve Tunus) için dış ticaret açıklarının sürdürülebilirliğini inceleyen çalışmada Husein (2014), panel veri analizi ve sınır testi kullanarak kullanılmıştır. Çalışma sonuçlarına göre, İran, İsrail, Ürdün ve Tunus açısından ihracat ve ithalat eşbütünleşik özellik göstermekte olduğundan bu ülkeler açısından dış ticaret açığının sürdürülebilir olduğu ifade edilmektedir. Baek (2016), G-7 ülkeleri (Kanada, Japonya, Fransa, Almanya, İtalya ve İngiltere) için 1989-2013 dönemindeki verileri kullanarak yaptığı çalışmada bu ülkeler için ihracat ve ithalat serileri arasındaki uzun dönem ilişkisini panel veri analizi ve sınır testi yaklaşımı ile analiz etmiştir. Çalışmada, Kanada, Fransa, Almanya, İtalya, Japonya ve İngiltere için dış ticaret açıklarının sürdürülebilir olduğu bulgusu elde edilmesine karşın İtalya ve ABD için açıkların sürdürülemez olduğu sonucuna ulaşılmıştır.

Arize ve Bahmani-Oskooee, (2017) yaptıkları çalışmada 100 ülke için 1973-2015 arası yıllara ait verileri kullanarak doğrusal ve doğrusal olmayan panel veri yöntemleriyle ihracat ve ithalat arasındaki eşbütünleşme ilişkisini test etmişlerdir. Doğrusal yöntemlerle yapılan testlerde eşbütünleşme oranı %60 oranında gerçekleşirken, doğrusal olmayan yöntemlerle yapılan testlerde %94 oranında eşbütünleşme verisi elde edilmiştir. Çalışma bulgularına göre ihracat odaklı ülkelerin daha hızlı büyüyeceği ve daha çok ithalat yapacağı öngörülmektedir. Daha fazla ithalat için gerekli girdi ithalatının ise ekonomik büyümeye yol açacağı ve büyümeye engel olmayacağı öngörülmüştür.

Literatürdeki çalışmalara dair genel bir değerlendirme yapmak gerekirse çalışmaların önemli bir bölümünde ihracat ve ithalatın eşbütünleşik olduğu izlenmekle beraber azımsanmayacak sayıda çalışmada eşbütünleşmenin ortaya çıkmamasına bağlı olarak dış ticaret açıklarının sürdürülemez olduğu bulgusunun elde edildiği görülmektedir.

3. MODEL, YÖNTEM ve VERİ SETİ

Sürdürülebilirliğin, ihracat ve ithalat değişkenleri arasındaki eşbütünleşme ilişkisiyle incelendiği çalışmalar literatürde önemli bir yer tutmaktadır. Husted (1992) çalışmasında ihracat (X) ve ithalat (M) arasındaki uzun dönemli ilişkiyi vurgulayan basit bir model kullanmıştır.

$$X_t = \alpha + \beta M_t + \varepsilon_t \quad (1)$$

Burada ekonominin dönemler arası bütçe kısıtını sağladığı varsayımı altında $\beta = 1$ ve ε_t durağan olmalıdır. Böylece dış ticaret açığının sürdürülebilirliği X_t ve M_t serilerinin eşbütünleşik olması koşuluyla eşbütünleşme katsayısı β 'nın bire eşit olması koşuluna bağlı hale gelmektedir. Bu koşul, Quintos (1995) tarafından geliştirilmiştir. Quintos (1995), β katsayısı 1'e eşit olduğunda açıkların güçlü formda, β katsayısı 0 ile 1 arasında olduğunda ise zayıf formda sürdürülebilir olduğu belirtmiştir.

Bu çalışmada 1984:01-2017:04 dönemi ihracat ve ithalat aylık verileri kullanılarak ele alınan dönem için Türkiye'de dış ticaret açığının sürdürülebilirliği araştırılmıştır. Çalışmada Quintos (1995) tarafından önerilen ve değişkenler arasında eşbütünleşme ilişkisinin test edilmesine dayanan yöntem kullanılmıştır. Çalışmada kullanılan her iki değişkende de mevsimsellik etkisi tespit edilmiş ve değişkenler TRAMO/SEATS yöntemi kullanılarak mevsimsel etkilerden arındırılmıştır.

Değişkenlerin bütünleşik derecelerini belirlemek amacıyla ADF birim kök testi uygulanmış ve elde edilen test değerleri Tablo 1'de sunulmuştur.

Tablo 1. ADF Birim Kök Testi Sonuçları

| Değişkenler | ADF Test İstatistiği | Kritik Değerler | | |
|-------------|----------------------|-----------------|--------|--------|
| | | (%1) | (%5) | (%10) |
| X | 0.386 [12] | -3.447 | -2.868 | -2.570 |
| ΔX | -6.851 [11]* | -3.447 | -2.868 | -2.570 |
| M | -0.504 [13] | -3.447 | -2.868 | -2.570 |
| ΔM | -5.749 [12]* | -3.447 | -2.868 | -2.570 |

Not: Köşeli parantez içindeki değerler, değişkenlerin, AIC'ye göre belirlenmiş uygun gecikme uzunluğunu belirtmektedir. *, ** ve *** sırasıyla; %1, %5 ve %10 anlamlılık düzeyinde durağanlığı ifade etmektedir.

Tablo 1'den izlenebileceği gibi ADF test istatistiği sonuçlarına göre, analizde kullanılan X ve M değişkenlerinin, düzey değerinde birim kök içerdiği ve serilerin I(1) olduğu sonucuna ulaşılmıştır.

Literatürde geliştirilen birçok eşbütünleşme testi bulunmaktadır. Bayer ve Hanck (2012), Engle ve Granger (1987), Johansen (1988), Boswijk (1994) ve Banerjee vd. (1998) eşbütünleşme testlerini birlikte değerlendiren ve bu testlerden daha güçlü olan yeni bir test geliştirmiştir. Bayer ve Hanck (2012), bireysel eşbütünleşme testlerinin hesaplanan olasılık değerlerini (p-değerleri) Fisher (1932) formülleriyle birleştirmeyi önermişlerdir. Buna göre, önerilen Fisher formülleri şu şekildedir:

$$\tilde{X}_I^2 = -2 \sum_{i \in I} \ln(p_i) \quad (2)$$

$$EG - JOH = -2 [\ln(PEG) + \ln(PJOH)] \quad (3)$$

$$EG - JOH - BO - BDM = -2 [\ln(PEG) + \ln(PJOH) + \ln(PBO) + \ln(PBDM)] \quad (4)$$

Burada, *PEG* ; Engle ve Granger (1987), *PJOH*, ; Johansen (1988), *PBO* ; Boswijk (1994), *PBDM* ; Banerjee vd. (1998) eşbütünlük testlerinin olasılık değerlerini göstermektedir. Bayer ve Hanck (2012) eşbütünlük testi sonuçları Tablo 2'de özetlenmiştir.

Tablo 2. Bayer ve Hanck (2012) Eşbütünlük Testi Sonuçları

| | Engle -Granger | Johansen | Boswijk | Banerjee vd. |
|--|-------------------------|-----------------|---------|--------------|
| Test İstatistikleri | -3.282 | 16.621 | 9.177 | -2.723 |
| Prob. | 0.056*** | 0.026** | 0.112 | 0.143 |
| Bayer ve Hanck (2012) Eşbütünlük Testi | | | | |
| | Fisher Test İstatistiği | Kritik Değerler | | |
| | | %1 | %5 | %10 |
| <i>EG - JOH</i> | 13.003** | 17.304 | 11.229 | 8.678 |
| <i>EG - JOH - BO - BDM</i> | 21.265*** | 33.969 | 21.931 | 16.964 |

Not: *, ** ve *** sırasıyla; %1, %5 ve %10 anlamlılık düzeyinde eşbütünlük ilişkisini ifade etmektedir. VAR modeli kullanılarak uygun gecikme uzunluğu 13 olarak elde edilmiştir.

Tablo 2'de Bayer ve Hanck (2012) eşbütünlük testi sonuçları incelendiğinde hesaplanan her iki Fisher test istatistiği değerine göre seriler arasında eşbütünlük ilişkisinin var olduğu görülmektedir. Çalışmada uzun dönem eşbütünlük katsayıları DOLS ve FMOLS yöntemiyle tahmin edilmiş, elde edilen sonuçlar Tablo 3'de sunulmuştur.

Tablo 3. Uzun Dönem Eşbütünlük Katsayıları

| Yöntem | Değişken | Katsayı | t-istatistiği | Prob |
|--------------|-------------|---------|---------------|---------|
| DOLS | M | 0.638 | 52.67 | (0.000) |
| | Sabit Terim | 43.441 | 0.72 | (0.468) |
| FMOLS | M | 0.640 | 70.48 | (0.000) |
| | Sabit Terim | 35.881 | 0.37 | (0.707) |

Tablo 3'de eşbütünlük denklemleri uzun dönem ilişkisini göstermektedir. Model sonuçlarına göre *X* ve *M* serileri arasında pozitif ve istatistiki olarak anlamlı bir ilişki bulunmaktadır. DOLS ve

FMOLS yöntemleri ile elde edilen eşbütünleşme denklemlerine göre M değişkeninin katsayısı (β) sırasıyla 0.638 ve 0.640 olarak elde edilmiştir. Elde edilen β katsayılarının 1 değerinden farklı olup olmadığı Wald testi ile sınanmış ve sonuçlar Tablo 4’de gösterilmiştir.

Tablo 4. β Katsayısının 1 Değerinden Farklı Olup Olmadığı Testi

| Yöntem | β | Test Edilen Katsayı | Test İstatistiği | Prob |
|--------|---------|---------------------|------------------|-------|
| DOLS | 0.638 | 1 | 888.38 | 0.000 |
| FMOLS | 0.640 | 1 | 1559.39 | 0.000 |

Tablo 4’de verildiği gibi hesaplanan test istatistiklerine göre $\beta=1$ temel hipotezi reddedilmektedir. Uzun dönem katsayısı 1’den küçük olduğundan, Türkiye’de dış ticaret açığının zayıf sürdürülebilir olduğu sonucuna varılmıştır.

4. SONUÇ ve ÖNERİLER

Bu çalışmada; Türkiye’de dış ticaret açıklarının sürdürülebilirliğinin incelenmesi amaçlanmıştır. Bu amaçla ele alınan 1984-2017 yıllarına ait ihracat ve ithalat serileri kullanılmış olup analiz aşamasında serilerin durağanlıkları, ADF birim kök testiyle incelenmiş ve serilerin düzey değerlerinde durağan olmayıp, birinci farkları alındığında durağan hale geldikleri görülmüştür. Seriler arasında eşbütünleşme ilişkisinin varlığı, Engle ve Granger (1987), Johansen (1991), Boswijk (1994), Banerjee vd. (1998) testlerinin kombinasyonu ile geliştirilen Bayer ve Hanck (2012) eşbütünleşme testi ile sınanmıştır. Eşbütünleşme testi sonucunda seriler arasında eşbütünleşme ilişkisinin var olduğu, yani serilerin uzun dönemde birlikte hareket ettikleri tespit edilmiştir. Uzun dönem eşbütünleşme katsayıları, DOLS ve FMOLS yöntemleriyle tahmin edilmiş ve ihracat ile ithalat değişkenleri arasında pozitif ve istatistiki olarak anlamlı bir ilişki bir ilişkinin var olduğu belirlenmiştir. Eşbütünleşme denkleminde β katsayılarının 1 değerinden farklı olup olmadığı Wald testi ile sınanmış ve katsayıların 1 değerinden küçük olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Elde edilen sonuçlar Türkiye’de dış ticaret açığının zayıf sürdürülebilir olduğunu göstermektedir. Literatürde Türkiye ile ilgili olarak cari açığın sürdürülebilirliğine ilişkin çok sayıda bulunmasına rağmen dış ticaret açıklarının sürdürülebilirliğini inceleyen çalışma bulunmadığı görülmektedir. Gelecekteki çalışmalarda Türkiye açısından dış ticaret dengesinin sürdürülebilirliğini inceleyen ve dış ticaret dengesini etkileyen unsurlara yönelik daha detaylı analizlere yer verilebilir.

Dış ticaret açığının makroekonomik göstergeler açısından taşıdığı önemden hareketle dış ticaret açıklarının azaltılmasına yönelik politikaların geliştirilmesinin gerektiği ifade edilebilir. İleride yapılacak çalışmalarda dış ticaretindeki zayıf yönlerin ortaya konulması bu politikaların geliştirilmesine katkı sağlayabilecektir. Dış ticaret dengesini sağlamak açısından yapısal reformlarla ithalatın azaltılması, yerli firmaların dış ticarete başarı sağlamalarına yönelik rekabet güçlerini artırıcı uygulamaların geliştirilmesi ve ihracatın ithal ara mallarına bağımlı olmaktan çıkarılmasını sağlayacak düzenlemelere gidilmesi politika önerileri olarak sayılabilir.

KAYNAKÇA

- Arize, A. C. (2002). "Imports and Exports in 50 Countries: Tests of Cointegration and Structural Breaks". *International Review of Economics & Finance*, 11(1): 101-115.
- Arize, A. C., & Bahmani-Oskooee, M. (2017). "Do Imports and Exports Adjust Nonlinearly? Evidence from 100 Countries". *Global Economy Journal*, 18(1).
- Baek, J. (2016). "Analyzing a Long-Run Relationship between Exports and Imports Revisited: Evidence from G-7 Countries". *Economics Bulletin*, 36(2): 665-676.
- Bahmani-Oskooee, M. (1994). "Are Imports and Exports of Australia Cointegrated?". *Journal of Economic Integration*, 525-533.
- Bahmani-Oskooee, M. and H Rhee, (1997) "Are Exports and Imports of Korea Cointegrated?" *International Economic Journal*, 11: 109-14.
- Banerjee, A., Dolado, J. ve Mestre, R. (1998). "Error-Correction Mechanism Tests for Cointegration in a Single-Equation Framework". *Journal of Time Series Analysis*, 19, (3): 267-83.
- Bayer, C. ve Hanck, C. (2012). "Combining Non-Cointegration Tests". *Journal of Time Series Analysis*, 34(1): 83-95.
- Boswijk, P.H. (1994). "Testing for an Unstable Root in Conditional and Unconditional Error Correction Models". *Journal of Econometrics*, 63: 37-60.
- Engle, R.F. ve Granger, C.W.J. (1987). "Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing". *Econometrica*, 55(2): 251-276.
- Göktaş, Ö. (2011). "Türkiye Ekonomisinde Bütçe Açığının Sürdürülebilirliğinin Analizi". *Ekonometri ve İstatistik e-Dergisi*, (8): 45-64.
- Herzer, D., & Nowak-Lehmann D, F. (2006). "Is There a Long-run Relationship between Exports and Imports in Chile?". *Applied Economics Letters*, 13(15): 981-986.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Husein, J. (2014). "Are Exports and Imports Cointegrated? Evidence from Nine MENA Countries". *Applied Econometrics and International Development*, 14(1): 123-132.
- Husted, S. (1992). "The Emerging US Current Account Deficit in the 1980s: A Cointegration Analysis". *The Review of Economics and Statistics*, 159-166.
- Irاندoust, M., & Ericsson, J. (2004). "Are Imports and Exports Cointegrated? An International Comparison". *Metroeconomica*, 55(1): 49-64.
- Johansen, S. (1988). "Statistical Analysis of Cointegration Vectors". *Journal of Economic Dynamics and Control*, 12: 231-54.
- Konya, L. and Singh, J.P. (2008) "Are Indian Exports and Imports Cointegrated?" *Applied Econometrics and International Development*, 8 (2).
- Kumar Narayan*, P., & Narayan, S. (2005) "Are Exports and Imports Cointegrated? Evidence from 22 Least Developed Countries". *Applied Economics Letters*, 12(6): 375-378.
- Mukhtar, T., & Rasheed, S. (2010). "Testing Long Run Relationship between Exports and Imports: Evidence from Pakistan". *Journal of Economic Cooperation and Development*, 31(1): 41-58.
- Perera, N., & Verma, R. (2008). "An Empirical Analysis of Sustainability of Trade Deficit: Evidence from Sri Lanka". University of Wollongong.
- Pillay, S. (2014). "The Long Run Relationship between Exports and Imports in South Africa: Evidence from Cointegration Analysis". *International Journal of Social, Behavioral, Educational, Economic, Business and Industrial Engineering*, 8(6): 113-128.
- Quintos, C. E. (1995). "Sustainability of the Deficit Process with Structural Shifts". *Journal of Business & Economic Statistics*, 13(4): 409-417.
- Tang, T. C. (2006). "A New Approach to Examining the Sustainability of External Imbalances: The Case of Japan". *Applied Economics Letters*, 13(5): 287-292.

**TÜRK TARIMINDA ÜRÜN ARZI YETERLİLİKLERİ VE EKONOMİK GELİŞMELERE
ETKİLERİ***

Prof. Dr. Mehmet Emin Erçakar**

ÖZET

Türkiye’de bitkisel üretim tarım sektörünün olduğu kadar Türkiye ekonomisinin de temel yapı taşlarından birini oluşturmaktadır. Bu nedenle bitkisel üretim, oldukça geniş bir üretici kitlesini ilgilendirmekte ayrıca gıda arzı ile doğrudan ilişkisi nedeniyle tüketici kesimini de ilgilendirmektedir. Bitkisel üretim dünyada olduğu gibi Türkiye nüfusunun beslenmesinde de büyük önem taşımanın yanında yalnız insanların beslenmesinde değil, hayvan varlığının yem ihtiyacı da bitkisel üretimle karşılanabildiğinden bu yönüyle de önem arz etmektedir.

Türkiye’de bitkisel üretim alanının %69’u tarla ürünleri, %19’u nadas alanları, %3’ü sebze üretim alanları, %5’i meyve alanları, %2’si zeytin alanları ve %2’si bağ alanları olarak değerlendirilmektedir(TÜİK Tarım İstatistikleri 2016).

Çalışmamızda amaçlanan konular arasında, Türkiye’deki bitkisel üretimin mevcut durumunun analizi (üretim, istihdam vb.), ülke ihtiyaçlarını karşılamadaki yeterlilik düzeyleri, tarımdan kaçışa alınabilecek tedbirler, tarımın ülke ekonomisi içerisindeki ve dış ticaretindeki payı gibi başlıkların yer alması planlanmaktadır.

Anahtar Kelimeler: *Türkiye Ekonomisi, tarım, bitkisel üretim, tarımda yeterlilik, ürün arz ve talebi.*

JEL Kodları: *Q10, Q17, R11.*

**PRODUCT SUPPLY COMPETENCIES IN TURKISH AGRICULTURE AND ECONOMIC
EFFECTS**

ABSTRACT

* Bu çalışma Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi Bilimsel Araştırma Projeleri (BAP) Koordinasyon Birimi tarafından BAP-18-İİBF-1009-114 Proje No’su ile desteklenmiştir.

** Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi İİBF İktisat Bölümü, Bandırma, Türkiye , mercakar@bandirma.edu.tr

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

In Turkey, herbal production is one of the basic elements of the Turkish economy as well as the agricultural sector. For this reason, herbal production concerns a wide range of producers and also concerns the consumer segment due to its direct relationship with food supply. As in the world of herbal production, it is also important to bear in the nutrition of the population of Turkey, not only in the nutrition of the people, but also because the animal presence can be met with herbal produce.

69% of crop production area in Turkey, 19% of the fallow areas, 3% vegetable production areas, 5% fruit fields, 2% olive fields and 2% are considered as vineyard areas (TURKSTAT Agricultural Statistics 2016).

Among the subjects intended in our study, analysis of the current state of plant production in Turkey (production, employment, etc.), qualification levels to meet the needs of the country, measures that can be taken from agriculture, the country's economy of farming such as the share in foreign trade.

Keywords: *Turkish Economy, agriculture, crop production, agricultural competencies, product supply and demand.*

JEL Codes: *Q10, Q17, R11.*

1.GİRİŞ

Ülkeler ekonomik yapıları bakımından üçlü sektör modeline dayalı bir ayrıma tabi tutulduğunda sanayi ve hizmet sektörlerinin yanında üçüncü olarak tarım sektörü yer almaktadır. Bu ayrıma rağmen tarım sektörünün diğer sektörlerle göre geçmişinin çok daha eskiye dayandığı yadsınamaz bir gerçektir. Bu durumun sebepleri arasında en başta geleni ise, tarım sektörü insanları doyuran gıda arzı sağlayan bir sektör olarak tartışmasız bir konuma sahiptir(Güner; 2016:33).

Tarımsal faaliyetlerin kendine özgü bir takım özellikleri mevcuttur (Çetin;2010:6-10): Birincisi; tarımsal üretim iklim ve toprak koşulları, ekilecek ürün deseni gibi özellikleri gereği doğal koşullara bağımlı kalmaktadır. İkinci olarak doğal koşullara bağımlılığın sonucu olarak çok sayıda risk ve belirsizlik söz konusudur. Üçüncü olarak tarım kesiminde üretimin istikrarlı olması çok zor olduğundan üretim mevsimsel ve dalgalanmalı seyir izlemektedir. Tarım sektörü sosyal nitelikler taşırken işletmeler genellikle dağınık arazi yapısına sahip küçük aile işletmeleri görünümündedir.

ABD, Avrupa Birliği gibi gelişmiş ve sanayileşmiş ekonomilerde günümüzde uzun vadeli tarım politikaları bakımından temel teşkil eden sorunlar, tarımın ekolojik etkileri, kırsal nüfusun giderek azalması, tarımsal üretim ve ithalattaki artışın ürün fiyatları ve üretici gelirlerini düşürmesi olarak ifade edilebilir. Diğer yandan bu tarz gelişmiş ekonomilerde tarımın ülke GSYİH'ları içerisindeki payı görece düşüktür. 2015 yılı verilerine göre örneğin ABD'de tarımın GSYİH içerisindeki payı % 1,1, Japonya'nın % 1,2, Almanya'nın % 0,9, İngiltere'nin ise % 0,7 düzeyindedir (World Bank, 2018).

Türkiye gibi gelişmekte olan ülkelerde ise, yüksek nüfus artışı sebebiyle verimliliğin ve üretim miktarlarının artırılması büyük önem arz etmektedir. Tarım sektörü sosyal nitelikler taşıyan işletmeler genellikle küçük aile işletmesi tarzındadır. Tarımın GSYİH içerisindeki payına bakıldığında ise, Türkiye’de bu oran % 8,3 düzeyinde iken diğer gelişmekte olan ülkelere Çin’de bu oran % 10, Hindistan’da % 18, Arjantin’de % 7, Polonya’da % 3,3, Rusya’da ise % 3,9 oranlarında gerçekleşmiştir (World Bank, 2018).

Bütün ülkeleri kapsayacak şekilde tarımın genel sorunlarına bakıldığında ise, hemen hemen bütün ülke ekonomilerinde ürün, fiyat ve gelirlerdeki istikrarsızlık, talebin fiyat ve gelir esnekliğinin düşüklüğü gibi birbirinden çok da farklılık arz etmeyen sorunlar ön plana çıkmaktadır. Bunun yanında köyden kente göç ve yüksek gelir gruplarının tüketim alışkanlıklarının değişmesi gibi birtakım sorunlar, insanlığın gıda temininden tüketimine kadar pek çok aşamada alışkanlıklarını değiştirmiştir.

Çalışmamızda tarım sektörünün dünya genelindeki genel durumu bu şekilde özetlendikten sonra ülkemiz tarımının genel yapısı incelenecektir. Bu kapsamda ülkemizin iklim koşullarının elverişliliği sebebiyle çok geniş alanlarda ve türde yapılan tarımsal üretimin arz yeterlilik durumları incelenmeye çalışılacaktır.

2. ÜLKEMİZDE ÇEŞİTLİ ÜRÜN GRUPLARINA GÖRE TARIMSAL YETERLİLİK DURUMLARI

Ülkemiz tarımsal üretim açısından gerek iklim yapısı gerekse toprak yapısı bakımından oldukça elverişli bir coğrafyada yer almaktadır. Bu durumun bir kanıtı olarak Tablo 1’e bakılabilir ki tabloda çok çeşitli tahıl türlerinin yer aldığı görülebilirken bu ürün segmentinde ortalama yeterlilik oranının 2016 yılı verileriyle % 97,2 olduğu görülmektedir. Özellikle burada stratejik ürün olan buğdayda yeterlilik oranının ihtiyaç duyulandan fazla (% 104) olması önemli iken, diğer yandan soya fasulyesi gibi yem sanayiinde yoğun kullanılan ve protein kaynağı olan bir üründe çok düşük bir arzın olması (% 7) dikkat çekmektedir. Ayrıca mısır (% 88) ve ayçiçeği (% 64) gibi yağlık ve besin değeri çok yüksek olan ürünlerin üretiminde de istediğimiz noktada olamadığımız görülmektedir.

Tablo 1. Türkiye’de Tahıl Üretiminin Yeterlilik Durumu (2016)

| 01.11. (Tahıl Toplam) | 2016 | 97,2 |
|---|-------------|-------------|
| 01.11.1. (Buğday) | 2016 | 103,8 |
| 01.11.11.00. (Buğday (Durum)) | 2016 | 153,4 |
| 01.11.12.00.00. (Buğday (Diğer)) | 2016 | 97,1 |
| 01.11.20.00.00. (Mısır (Dane)) | 2016 | 87,8 |
| 01.11.31.00. (Arpa) | 2016 | 89,2 |
| 01.11.32.00.00. (Çavdar) | 2016 | 97,1 |
| 01.11.33.00.00. (Yulaf) | 2016 | 99,3 |
| 01.11.49.00. (Diğer Tahıllar) | 2016 | 94,1 |
| 01.11.61.00.01. (Fasulye (Taze)) | 2016 | 100,3 |
| 01.11.62.00.00. (Bezelye (Taze)) | 2016 | 102,9 |
| 01.11.69.00.02. (Bakla (Taze)) | 2016 | 103,6 |
| 01.11.7. (Kuru Baklagil (Toplam)) | 2016 | 82,9 |
| 01.11.71.00. (Kuru Fasulye) | 2016 | 81,8 |
| 01.11.73.00.00. (Nohut) | 2016 | 92,1 |
| 01.11.74.00.01. (Kırmızı Mercimek) | 2016 | 76,7 |
| 01.11.74.00.02. (Yeşil Mercimek) | 2016 | 46,1 |
| 01.11.81.00.00. (Soya Fasulyesi (Kuru)) | 2016 | 7,1 |
| 01.11.84.00.00. (Pamuk Tohumu (Çiğit)) | 2016 | 101 |
| 01.11.93.00.00. (Kolza) | 2016 | 76,7 |
| 01.11.95.00. (Ayçiçeği) | 2016 | 64 |

Kaynak: TÜİK, Tarımsal İstatistikler.

Ülkemizde sebze meyve tarımına ait ürünlerin yer aldığı Tablo 2’ye bakıldığında yine sebze meyve türlerinin genel üretim düzeyinin ülke ihtiyaçlarının üzerinde olduğu (% 107 oranıyla) görülmektedir. Bunun yanı sıra özellikle incirdeki (% 727), üzüm (% 142) ve domatesteki (% 111) üretim düzeyleri dikkat çekicidir.

Tablo 2. Türkiye’de Sebze Üretiminin Yeterlilik Durumu (2016)

| 01.13. (Sebze Toplam) | 2016 | 106,7 |
|-----------------------------------|-------------|--------------|
| 01.13.12.00. (Lahana) | 2016 | 101,2 |
| 01.13.14.00. (Marul) | 2016 | 100,6 |
| 01.13.16.00.00. (Ispanak) | 2016 | 102,5 |
| 01.13.19.00.03. (Semizotu) | 2016 | 100 |
| 01.13.21.00.00. (Karpuz) | 2016 | 99,7 |
| 01.13.29.00.00. (Kavun) | 2016 | 100,4 |
| 01.13.31.00. (Biber) | 2016 | 108,9 |
| 01.13.32. (Hıyar) | 2016 | 106,1 |
| 01.13.33.00.00. (Patlıcan) | 2016 | 102,8 |
| 01.13.34.00. (Domates) | 2016 | 111,3 |
| 01.13.39.00.01. (Bamya) | 2016 | 99,7 |
| 01.13.39.00.02. (Kabak (Sakız)) | 2016 | 107,2 |
| 01.13.41.00.01. (Havuç) | 2016 | 113,2 |
| 01.13.42.00.02. (Sarımsak (Kuru)) | 2016 | 99,9 |
| 01.13.43.00.01. (Soğan (Taze)) | 2016 | 100,4 |
| 01.13.43.00.02. (Soğan (Kuru)) | 2016 | 112,7 |
| 01.13.44.00.01. (Pırasa) | 2016 | 103,5 |
| 01.13.49.03. (Turp) | 2016 | 100,5 |
| 01.13.51. (Patates) | 2016 | 108,2 |
| 01.13.71.00.00. (Şeker Pancarı) | 2016 | 100 |
| 01.21.1. (Üzüm) | 2016 | 141,6 |
| 01.22.12.00.00. (Muz) | 2016 | 58,3 |
| 01.22.14.00.00. (İncir) | 2016 | 727,4 |

Kaynak: TÜİK, Tarımsal İstatistikler.

Tablo 3’deki turunçgil üretimi de ülkemizdeki iklim koşullarının tarım için ne derece elverişli olduğunun ispatı gibidir. Zira turunçgiller görece sıcak iklim seven ürünler iken neredeyse bütün türlerin ülkemizde ziraatının yapılabildiği görülmektedir. Bunun yanında genel yeterlilik düzeyinin % 176 gibi oldukça yüksek bir oranda olduğu söylenebilir. Kayısdaki % 309’luk, limondaki % 246’lık, mandalinalardaki % 210’luk oranlar da bu ürünlerin Türkiye’nin tarımsal ürün ihracatında önemli paya sahip olmalarının göstergesidir.

Tablo 3. Türkiye’de Turunçgil Üretiminin Yeterlilik Durumu (2016)

| 01.23.1. (Turunçgiller Toplamı) | 2016 | 175,7 |
|--|-------------|--------------|
| 01.23.11.00.01. (Greyfurt) | 2016 | 209 |
| 01.23.12.00.00. (Limon) | 2016 | 246,7 |
| 01.23.13.00. (Portakal) | 2016 | 145,1 |
| 01.23.14.02. (Mandalina) | 2016 | 209,7 |
| 01.24.10.00. (Elma) | 2016 | 135,9 |
| 01.24.21.00.00. (Armut) | 2016 | 105,4 |
| 01.24.22.00.00. (Ayva) | 2016 | 112,3 |
| 01.24.23.00.01. (Kayısı) | 2016 | 308,7 |
| 01.24.24.00.01. (Kiraz) | 2016 | 119 |
| 01.24.24.00.02. (Vişne) | 2016 | 100,1 |
| 01.24.25.00.00. (Şeftali) | 2016 | 107,3 |
| 01.24.27.00.00. (Erik) | 2016 | 118,9 |
| 01.24.29.00.99. (Diğer Meyveler) | 2016 | 103,7 |
| 01.25.13.00.00. (Çilek) | 2016 | 108,5 |
| 01.25.19.00.06. (Dut) | 2016 | 101,6 |

Kaynak: TÜİK, Tarımsal İstatistikler.

Sert kabuklu meyveler kategorisinin yer aldığı Tablo 4’ de de yine Türkiye’nin yeterlilik oranı 2016 yılı verileriyle % 139’dur. Bu segmentte de arzı en fazla olan ürün % 413 oranıyla aynı zamanda önemli ihraç ürünlerimizden olan fındık olmuştur. Bu ürünü 5 113 ile kestane ve % 108 ile Antep fıstığı takip etmektedir.

Tablo 4. Türkiye’de Sert Kabuklu Ürünlerin Üretiminin Yeterlilik Durumu (2016)

| 01.25.3. (Sert Kabuklular Toplamı) | 2016 | 138,7 |
|---|-------------|--------------|
| 01.25.31.00.00. (Badem) | 2016 | 83 |
| 01.25.32.00.00. (Kestane) | 2016 | 113,5 |
| 01.25.33.00.00. (Fındık) | 2016 | 413,1 |
| 01.25.34.00. (Antep Fıstığı) | 2016 | 108,2 |
| 01.25.35.00.00. (Ceviz) | 2016 | 76,7 |
| 01.25.90.00.03. (Nar) | 2016 | 161 |
| 01.27.12.00.00. (Çay) | 2016 | 95,4 |
| 10.61.12. (Pirinç) | 2016 | 69,9 |
| 10.81. (Şeker) | 2016 | 103 |

11.02. (Şarap)

2016

116,7

Kaynak: TÜİK, Tarımsal İstatistikler.

Tarım sektörünün ürün bazında yeterlilik durumlarından sonra sektörün makroekonomik açıdan ne anlam ifade ettiğine bakacak olursak, 2009 – 2018 Haziran döneminin yer aldığı aşağıdaki Tablo 5’de cari fiyatlarla GSYİH’nın ve tarım sektörünün yıllar itibariyle gelişimi görülmektedir. Buna göre ülkenin büyüme oranları ile tarım kesiminin büyüme oranlarının farklılıklar taşıdığı görülmektedir. Bu duruma sebep olarak tarım kesiminde iklim şartlarının yıllar itibariyle değişiminin verimliliği etkilemesi önemli bir kısıt oluştururken, diğer yandan sektörün yıllar itibariyle gerek çiftçi sayısı gerekse ekilen tarım alanı bakımından düşüş trendinde olması da dikkate alınması gereken bir tabloyu ortaya koymaktadır.

Tablo 5. Gayrisafi Yurtiçi Hasıla'nın Yıllar İtibariyle Gelişimi ve Tarımın Payı (2009=100) (Bahçılık Dahil)

| Yıllar | Tarım* (Bin TL) | Gelişme Hızı (%) | Tarımın Payı (%) | Türkiye (Bin TL) | Gelişme Hızı (%) |
|--------------|--------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 2009 | 81.234.274 | 4,1 | 8,1 | 999.191.848 | -4,7 |
| 2010 | 87.464.906 | 7,7 | 8,1 | 1.083.996.979 | 8,5 |
| 2011 | 90.473.489 | 3,4 | 7,5 | 1.204.466.935 | 11,1 |
| 2012 | 92.459.744 | 2,2 | 7,3 | 1.262.160.182 | 4,8 |
| 2013 | 94.603.925 | 2,3 | 6,9 | 1.369.334.107 | 8,5 |
| 2014 | 95.164.941 | 0,6 | 6,6 | 1.440.083.365 | 5,2 |
| 2015 | 104.084.510 | 9,4 | 6,8 | 1.527.725.206 | 6,1 |
| 2016 | 101.399.804 | -2,6 | 6,4 | 1.576.365.403 | 3,2 |
| 2017 | 106.347.301 | 4,9 | 6,3 | 1.693.665.799 | 7,4 |
| 2018-6 Aylık | 27.455.587 | 1,2 | 3,3 | 826.224.034 | 6,2 |

Kaynak: Tarım ve Orman Bakanlığı, Tarımsal Veriler.

Türkiye’deki istihdam ve bu istihdam içerisinde tarımın payının görüldüğü Tablo 6’da tarım kesiminde istihdam edilenlerin sayısı yıllar itibariyle pek değişiklik göstermezken, oransal olarak bakıldığında ise tarımın istihdam içindeki payının azalma trendinde olduğu görülmektedir. Aynı durum sanayi sektörü içinde geçerli olmakla birlikte bu iki reel sektör bileşeninden açığa çıkan işgücünün ise hizmet sektörüne kaymakta olduğu anlaşılmaktadır. Ancak hizmet sektörü GSYİH içerisinde ağırlıklı paya sahip olmakla birlikte tarım ve sanayi sektörlerinin doğrudan üretim ekonomisini belirleyen alanlar olması nedeniyle istihdam içindeki paylarının azalması önlem alınması gereken bir durumun varlığına işaret etmektedir.

Tablo 6. Türkiye'de İstihdam ve İşsizlik İçerisinde Tarımın Payı

| YILLAR | Genel İşsizlik Oranı (%) | Tarım Dışı İşsizlik Oranı (%) | Toplam İşgücü | Toplam İstihdam | Tarım | | Sanayi | | İnşaat | | Hizmetler | |
|--------------|--------------------------|-------------------------------|---------------|-----------------|-------|------|--------|------|--------|-----|-----------|------|
| | | | | | Kişi | % | Kişi | % | Kişi | % | Kişi | % |
| 2010 | 11,1 | 13,7 | 24.594 | 21.858 | 5.084 | 23,3 | 4.615 | 21,1 | 1.434 | ,6 | 10.725 | 49,1 |
| 2011 | 9,1 | 11,3 | 25.594 | 23.266 | 5.412 | 23,3 | 4.842 | 20,8 | 1.680 | 7,2 | 11.332 | 48,7 |
| 2012 | 8,4 | 10,3 | 26.141 | 23.937 | 5.301 | 22,1 | 4.903 | 20,5 | 1.717 | 7,2 | 12.016 | 50,2 |
| 2013 | 9,0 | 10,9 | 27.046 | 24.601 | 5.204 | 21,2 | 5.101 | 20,7 | 1.768 | 7,2 | 12.528 | 50,9 |
| 2014 | 9,9 | 12,0 | 28.786 | 25.933 | 5.470 | 21,1 | 5.316 | 20,5 | 1.912 | 7,4 | 13.235 | 51,0 |
| 2015 | 10,3 | 12,4 | 29.678 | 26.621 | 5.483 | 20,6 | 5.332 | 20,0 | 1.914 | 7,2 | 13.891 | 52,2 |
| 2016 | 10,9 | 13,0 | 30.535 | 27.205 | 5.305 | 19,5 | 5.296 | 19,5 | 1.987 | 7,3 | 14.617 | 53,7 |
| 2017 | 10,9 | 13,0 | 31.643 | 28.189 | 5.464 | 19,4 | 5.383 | 19,1 | 2.095 | 7,4 | 15.246 | 54,1 |
| 2018 Ağustos | 11,1 | 13,2 | 32.989 | 29.318 | 5.697 | 19,4 | 5.730 | 19,5 | 2.071 | 7,1 | 15.820 | 54,0 |

Kaynak: TÜİK.

Son olarak tarım sektörünün Türkiye'nin dış ticareti içerisindeki payı ve öneminin incelendiği Tablo 7'ye bakıldığında ise, tarım sektörünün GSYİH içindeki ve istihdam içerisindeki gelişmelere paralel biçimde tarım ve hayvancılık kaynaklı ihracatın payının azalış trendinde olmasına karşın ithalatın ise artış meylinde olduğu söylenebilir. Böylece tarım ürünlerinin dış ticaretinde açık verildiği görülmektedir.

Tablo 7. Türkiye'nin Dış Ticaretinin Gelişimi ve Tarımın Payı

| Yıllar | Toplam İhracat | Tarım ve Hayv. İhracatı (%) | Toplam İthalat | Tarım ve Hayv. İthalatı (%) |
|--------------|----------------|-----------------------------|----------------|-----------------------------|
| 2018 (Eylül) | 123,1 | 3,7 | 174,2 | 7,5 |
| 2017 | 157,0 | 5,3 | 233,8 | 8,9 |
| 2016 | 142,6 | 5,4 | 198,7 | 6,9 |
| 2015 | 143,9 | 5,8 | 207,3 | 7,1 |
| 2014 | 157,6 | 6,0 | 242,2 | 8,5 |

Kaynak: TÜİK.

3. SONUÇ VE DEĞERLENDİRME

Ülkemiz gerek iklim gerekse toprak yapısı itibariyle tarımsal üretim için son derece olumlu koşullara sahiptir. Nüfusumuzun yaklaşık üçte birinin doğrudan ya da dolaylı olarak tarımsal faaliyetlerle geçimini sağladığı, istihdamın yaklaşık dörtte birinin tarımda istihdam edildiği, tarımsal üretimin yıllık 60 milyar \$ düzeylerini aşmış durumda olduğu, Türkiye'deki endüstri tesislerinin büyük bölümünün hammadde teminini gerçekleştiren bir sektör söz konusu olmaktadır. Haliyle böyle bir altyapıya sahip sektörün yani tarımın sanayimizin ve tabii ki ülkemizin gelişmesinde büyük önem taşıdığı yadsınamaz bir gerçektir.

Diğer yandan başka ülkelerle dış ticaretimiz açısından da ülke olarak ihracatımızda fındık, turunçgil, pamuk, tütün, yağ bitkileri, zeytin ve çay gibi tarım ürünleri önemli yer tutmaktadır. Her ne tarım ürünlerinin dış ticaretinde açık verilse de ülkemiz bu durumu tersine çevirecek ve katma değerli tarım ürünleri üretecek potansiyele sahiptir.

Ülkemizde tarım ürünlerinin desteklenmesi konusunda farklı uygulamalar yürütülmektedir. Tarım Kanunu'nun 6. maddesinde belirlenen politika önceliklerini de dikkate alarak, aynı Kanun'un 21. maddesi hükmünce GSYİH'nin % 1'inden (yüzde bir) az olmamak üzere tarım sektörünün desteklenmesi öngörülmekte iken maalesef çeşitli gerekçelerle bu oran henüz gerçekleşemediğinden bu anlamda mevcut desteklerin artırılmasına ihtiyaç duyulmaktadır. Özellikle köyünden ekonomik gerekçelerle ayrılan tarım ve hayvancılıkla uğraşan vatandaşlarımızın tekrar köyüne dönmesi pek mümkün görülmediğinden mevcut desteklerin artırılarak bu insanların doğduğu topraklarda doyurulması ülke çıkarları açısından çok önemli görülmektedir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

KAYNAKÇA

Çetin, B. (2010). Tarım Ekonomisi, Dora Yayınları, Bursa.

Gürler, A. Z.,(2016). Tarım Ekonomisi ve Politikası, Nobel Yayınları, Ankara.

Dinler, Z. (2012). Bölgesel İktisat, Ekin Basım Yayın Dağıtım, Bursa.

Tarım Kanunu, T.C. Başbakanlık Resmi Gazete.

T.C. Tarım ve Orman Bakanlığı (2017). BÜGEM Faaliyetleri.

T.C. Tarım ve Orman Bakanlığı (2018). <https://www.tarimorman.gov.tr/Konular/Tarimsal-Destekler>

T.C. Tarım ve Orman Bakanlığı (2018).

https://www.tarimorman.gov.tr/Belgeler/SagMenuVeriler/Tarimsal_Veriler.pdf

T.C. Kalkınma Bakanlığı, (2013). Onuncu Kalkınma Planı 2014-2018 Bitkisel Üretim Özel İhtisas Komisyonu Raporu.

TİM, (2016). Türkiye İhracatçılar Meclisi Tarım Raporu, İstanbul.

TÜİK, Tarımsal İstatistikler, Çeşitli Yıllar, www.tuik.gov.tr

TÜİK, Bitkisel Ürün Denge Tabloları, www.tuik.gov.tr

World Bank (2018). National Accounts Data,

<https://data.worldbank.org/indicator/NV.AGR.TOTL.KD.ZG>

**THE CHALLENGES FACED BY OCCUPATIONAL PSYCHOLOGISTS IN SELECTION
AND ASSESSMENT PROCESSES**

Dr. Meltem Yavuz*

Prof. Dr. Rifat Kamaşak**

ABSTRACT

Selecting new talents with unique characteristics and creative skills, matching them with the most suitable positions, developing their potential for learning, and integrating them to organisation in a versatile manner can result in lower turnover rate, maintained organisational culture, more efficient production and higher bottom-line profit. Therefore, a considerable attention has been paid for the selection and assessment (S&A) processes of new employees by firms. The S&A process conducted by occupational psychologists includes a number of critical tasks such as job analysis, identification of selection criteria and designing the assessment methods and tools to find the most suitable candidate for the role and predict his/her subsequent job performance. This study describes the main challenges faced by the occupational psychologists such as conducting reliable job analysis, using the most valid and appropriate assessment methods and addressing the diversity and fairness issues in the area of S&A.

Keywords: *Occupational psychology, Human resources, Diversity, Recruitment, Selection and assessment*

JEL Codes: *M10, M12, M54*

1. INTRODUCTION

Since the strategic importance of human resources (HR) increased and many firms started to link organisational performance to quality of human capital, in particular, selection and assessment (S&A) of the best candidates for the right job has become a primary objective for firms (Lievens & Patterson, 2011; Morgeson, Spitzmuller, Garza, & Campion, 2016). Therefore, a considerable attention has been paid for the S&A processes of new employees by firms (Derous & DeWitte, 2001; Morgeson et al., 2016; Schmitt & Chan, 1998). Although the idea behind the implementation of S&A process is that “true variance in a candidate’s behaviour can be identified by the assessment method” (Anderson, 2001, p. 84), the dynamic nature of S&A involving an “iterative process that evolves over the course of time” (Koczwara & Ashworth, 2013, p. 296) makes the process more than complex and even complicated. Besides, emergence of a new kind of economy based on services, knowledge, creativeness, and

* Istanbul University, Istanbul, Turkey, meltem.yavuz@istanbul.edu.tr

** Bahcesehir University, Istanbul, Turkey, rifat.kamasak@eas.bau.edu.tr

innovation generated new job specifications to be analysed and described (Becker & Huselid, 2006; Coff & Kryscynski, 2011). Additionally, the growing amount of diverse workforce, their varying expectations from jobs, and the necessity of finding the best candidate-position fit compelled occupational psychologists to develop and design new S&A methods for achieving better recruitment outcomes (Morgeson & Dierdorff, 2011; Morgeson et al., 2016). In this dynamic context, occupational psychologists have started to confront with several challenges in implementing S&A processes. This study aims to outline and describe the main challenges faced by the occupational psychologists that are the requirement of firms from them to have more “comprehensive and reliable job analysis systems and techniques” (Morgeson et al., 2016, p. 1905), to use the most valid and appropriate assessment methods ensuring the best role and candidate fit (Koczwara & Ashworth, 2013; Lievens & Patterson, 2011), and to address the diversity and fairness issues in the area of S&A (Dainty & Lingard, 2006).

2. THE NECESSITY OF COMPREHENSIVE AND RELIABLE JOB ANALYSIS SYSTEMS AND TECHNIQUES

Job analysis is defined as “a wide variety of systematic procedures for examining, documenting, and drawing inferences about work activities, worker attributes, and work context” (Sackett & Laczko, 2003, p. 21). A great number of theorists and practitioners (e.g. Morgeson et al., 2016; Oswald, 2003; Posthuma, Campion, Masimova, & Campion, 2013) considers job analysis as the preceding step of the S&A processes, learning and development facilities, wage-salary management, and performance appraisal. As the most commonly used organisational data collection activity (Morgeson et al., 2016), job analysis which comprises information about “the responsibilities, tasks, working conditions, organisational position and knowledge, skills and abilities (KSA) relevant to a given role” (Koczwara & Ashworth, 2013, p. 300) plays a crucial role in the S&A process. Given the rapidly changing business conditions that has been facilitated by new technologies and a highly diversified pool of, the need for firms to follow a flexible and cross-functional workforce has increased (Burke & Cooper, 2006; Morgeson & Dierdorf, 2011). Besides, many different roles or new identified jobs have been created and finding the best fit for these roles required more sophisticated job analysis techniques for organisations (Morgeson et al., 2016). The overriding interest in the technical adequacy of job analyses and the need for more sophisticated job analysis techniques made traditional job analysis approach incompetent (Sanchez & Levine, 2012; Morgeson et al., 2016). Traditional job analysis which adopts a “decomposed judgement strategy” (Morgeson et al., 2004; Sanchez & Levine, 2012) consider the discrete elements of job and highly detailed task statements and mostly focus on person-job (P-J) fit rather than person-organisation (P-O) fit. However, Lauer and Kristof-Brown (2001) who highlight the importance of a more holistic approach in job analysis state that “an employee can possess the skills to be competent in a job, yet not share the organisation’s values and vice versa. Thus, fit with one aspect of the work environment does not necessarily imply fit with the other” (p. 455). Apart from neglecting

some other potential organisational factors, the too technical, expensive and time-consuming nature of the decomposed strategy approach made occupational psychologists shift their concern to a “holistic judgement strategy” which “focuses on obtaining general and abstract overall evaluations of more global job components, such as job duties” (Morgeson et al., 2016, p. 3). In fact, the idea behind this shift is that many specific elements of decomposed analyses might occur in the final estimate of a given job component that can be determined by more abstract job descriptors with fewer judgments at a lower cost and less time (Morgeson et al., 2016). At this point, although an elaborate convergence of both strategies seem a necessity for occupational psychologists, research comparing decomposed and holistic judgement strategies yielded mixed and somewhat inconclusive results on the role of holistic ratings (Harvey & Wilson, 2000; Morgeson et al., 2016). If data generated by holistic judgment do not produce equivalent information with data generated by decomposed judgement (which is known as a long and well-established job analysis practice), the efficacy and efficiency of the S&A processes and training programmes may become questionable in terms of lack of key skills in the selection battery and/or lack of the key content in the training programmes (Morgeson et al., 2016). Besides, legal defensibility of defined key skills and their job-relatedness may be hindered where examined. Therefore, considering “the questions about the quality and appropriateness of holistic type of global judgements” (Morgeson et al., 2016, p. 27), the convergence of decomposed and holistic judgement strategies in job analysis still exists as a dilemma for occupational psychologists to be addressed.

3. THE USE OF APPROPRIATE ASSESSMENT METHOD

While the workforce which is increasingly diverse in terms of gender, race, education, culture, belief, life style, and nationality provides several financial and non-financial organisational outcomes, (Choi & Rainey, 2010; Ng & Burke, 2005), it also produces some challenges for occupational psychologists in the S&A field (Koczwara & Ashworth, 2013). The choice of assessment method can vary according to a number of factors such as suitability, cost and time frame of the S&A process. Given the diverse nature of the workforce and individual differences between applicants which require the custom-fit designed assessment methods to hire the most suitable candidate, the preparation of unique assessment methods can become a great challenge for occupational psychologists.

Moreover, apart from the traditional process of S&A aiming “to fit candidates to the job” (Derous & DeWitte, 2001), the concept of “two-way communication in assessment” (Gilliland, 1993; Wanous, 1992) between the firm and the applicant that has been burgeoning since 1980s, changed the passive role of the applicant towards satisfying the expectations of both parties equally in the S&A process. After the emergent role of S&A as a two-way social process, the occupational psychologists needed to add another dimension to the existing multi-faceted assessment tools to ensure that the process does not only match the job requirements with the individual's qualifications but it also enables the applicant to

match “his or her needs with the role requirements, and the organisation's culture and values” (Koczwara & Ashworth, 2013, p. 299). The changing role of an applicant in the two-way S&A process has been clarified by Herriot (2004) who describes the selection process “as a series of social interactions, during which the applicants match their own social identities to their current perceptions of the organisation in order to make decisions about whether to stay or leave a selection process” (p. 75).

In regard to the technical features of various methods and tests such as CV, application form, biodata and reference checks (Searle, 2003), unstructured and structured interviews (Cook, 2016), simulations and work sample tests (Lievens & Patterson, 2011), and psychometric tests (Ones, Viswesvaran, & Dilchert, 2005) that are employed in the S&A processes, occupational psychologist must also “consider reliability, validity and utility when choosing these” (Koczwara & Ashworth, 2013, p. 299) tests. While reliability in assessment refers to the adequate and accurate measurement provided by the assessment method used, validity refers to “the extent to which an assessment method measures the attribute it claims to measure” (Koczwara & Ashworth, 2013, p. 306). According to Koczwara and Ashworth (2013), reliability that has sub-dimensions like test re-test reliability and internal consistency “is evident in two components: the extent to which the assessment produces scores that are stable over time; and the extent to which the items in the assessment are consistent” (p. 306), whereas assessment validity may come from its constructs that are face, content, construct, and criterion validity. As observed, reliability and validity measurement also includes a number of constructs which should be treated carefully to maximise the success of S&A process. All assessment methods may have some weaknesses, for example, structured interviews assume that “past behaviour will predict future behaviour of an applicant” (Koczwara & Ashworth, 2013, p. 309), but given the unpredictable and changeable behaviours of human over time, what is expected now may not happen in future and the results obtained from the current interview can mislead occupational psychologists on the way of formulating and implementing thorough HR strategies. For this reason, the S&A processes should not be relying on a single method, and the method should be used in combination with other methods where appropriate (Marcus, Goffin, Johnston, & Rothstein, 2007; Morgeson et al., 2007). However, against the maximum efforts of occupational psychologists, reliability and validity may not always be addressed because of the subjective information provided by applicants, false or exaggerated declarations, subjective probability or confidence of decision makers in one’s judgment and inability of an interview or a psychometric test in measuring an applicant’s personality features or competencies (Kausel, Culbertson, & Madrid, 2016; McKinney et al., 2003; Schmidt & Hunter, 1998). A final issue that occupational psychologist must deal with is to ensure the optimum level of cost and benefit balance in the process of S&A which is termed “utility” (Macan & Foster, 2004). Given the resource scarcity (e.g. finance, time, personnel) in organisations and the pressure from top management on they way of producing the best solution through the most economic budget, occupational psychologists might be responsible of

calculating “the benefit of S&A process by appraising a combination of factors related to quality, quantity and costs” (Koczwara & Ashworth, 2013, p. 307) by conducting additional utility analyses.

Therefore, the selection and/or design of a sophisticated and accurate blend of different assessment methods coupled with utility expectations to ensure the best person and organisation fit may become a considerable challenge for occupational psychologists who perform S&A processes in a context where intangible elements (e.g. subjectivity, prejudices, changing behaviours, vagueness in measurements, dynamic business environment) might complicate the whole process.

4. DIVERSITY ISSUES, FAIRNESS AND LEGAL REQUIREMENTS

With the effect of globalisation and free movement of people and goods across borders, a global employment pool where highly diversified workforce occurs has emerged. Undoubtedly, the emergence of diversity issue and management of diversity effectively brought a great deal of benefits to firms. That being said, the same situation also created some difficulties to occupational psychologists which became a challenge for them. Apart from the challenges in relation to the selection of the most appropriate assessment methods to fit extremely varying reciprocal needs and expectations of diversified workforce and organisations mentioned in the previous section, fairness and perceptual fairness of the S&A processes and their suitability to legal requirements can be considered as other challenges faced by occupational psychologists (Dainty & Lingard, 2006; Koczwara & Ashworth, 2013). Although the legal frameworks of some countries (e.g. the UK, the EU, and the USA) encompassing the laws about equal employment opportunities may have certain rules in common, in the context of globalisation of organisations where S&A processes are conducted in a diverse range of legal enforcements, occupational psychologists have to be aware of any differences in employment and recruitment laws and they must consider discrimination issues, particularly. According to Koczwara and Ashworth (2013), “discrimination occurs when a person is treated differently and less favourably to people in another group” (p. 322). In order to minimise the conduct of discrimination, employment laws prohibit firms from stating their preferences for candidates in terms of age, gender, ethnicity, and disability in job announcements. Even if a specific job requires an essential and indispensable characteristic from the applicants, this cannot be reflected to job advertisements. However, the responsibility of an occupational psychologist is to ensure the best person-organisation fit and discrimination may be considered in different forms in different contexts which comprise S&A processes as well. Then, the achievement of reasonable adjustments in the S&A processes without being subject to any claims about discrimination may become another struggle for occupational psychologists. In this context, the issues that must be addressed by occupational psychologists are to ensure an equal treatment and a reciprocal fairness between the applicants and firms in the S&A process, and to provide modified or adjusted tests which reduce adverse impacts and biases particularly against minorities, ethnic groups, and disabled applicants

(Koch, Sackett, & D'Mello, 2015; Roth, Bevier, Bobko, & Tyler, 2001) through offering “additional time during assessments or using assessment materials in different sizes or formats” (Koczwara & Ashworth, 2013, p. 319).

Adverse impact is defined as “a substantially different rate of selection in hiring, promotion, or other employment decision which works to the disadvantage of members of a race, sex, or ethnic group” (O’Connell, Kung, & Wolf, 2014, p. 1). Similarly, Koczwara and Ashworth (2013) state that “adverse impact occurs when there is a disproportionate success rate on the test for certain groups in assessment” (p. 320). Two methods were mostly mentioned to measure adverse impact that are the four-fifths rule (Newman & Lyon, 2009) and the statistical significance test sub-group d (Roth et al., 2001). While the four-fifths rule refers that the selection ratio of any sex, race, or ethnic sub-group (e.g. female) should not fall below 80% of the the sub-group with the highest (e.g. male) selection ratio (Newman & Lyon, 2009), the d statistics refers to “the difference in means (e.g. white vs. black) divided by the sample weighted average of the group standard deviations” (Roth et al., 2001, p. 299). In highly diversified workforce, the assessment of ethnic and minority groups has received a particular attention since ethnic group differences on cognitive ability greatly varied (Ployhart & Holtz, 2008; Roth et al., 2001; Sackett & Ellingson, 1997). Cognitive ability measures are considered among the most valid predictors of job performance, thus they can influence organisations’ selection and assessment decisions (Dunleavy, Morris, & Howard, 2015; Roth et al., 2001). At this critical point, an occupational psychologist has responsibility to identify if any cognitive skill difference has derived from the bias occurring in the test/assessor or not. Given the fact that some ethnic minority groups might intend to take lower marks from assessment tests or other measures resulting from their limited possession of academic and job-related opportunities, Ployhart and Holtz (2008) claim that the assessment of ability and academic attainment of ethnic groups should not be carried out through standardised procedures. Therefore, during the S&A process, the occupational psychologist should make sure that the S&A process did not have an adverse impact on disadvantage groups (Cousans, n.d.).

Finally, the adoption of two-way communication influenced the applicants’ perception of fairness and justice in the S&A processes which might become a legal issue. Besides, the message that a firm emits to society regarding its fairness and justice in treating the applicants in all its recruitment processes does not only attract the best talent for which the organisations compete, but it also enhances the corporate reputation of the organisation leading to performance (Patterson et al., 2011; Phillips & Gully, 2002). Thus, maintaining perceived procedural and distributive justice along with fairness in the S&A processes (Truxillo, Steiner, & Gilliland, 2004) can be considered as another vital contribution of an occupational psychologists to organisational performance.

5. CONCLUSION

In the global business context where firms compete with each other to find, attract, and hire the best talents and match their skills with the most suitable role in organisation on the way sustaining competitive advantage, the role that occupational psychologists play becomes more and more crucial. Surrounded by the competitive, legal, and organisational restrictions, occupational psychologists show extensive effort to provide the best match and mix in the S&A processes. As aforementioned, given a number of tradeoffs between diversity, fairness and ethical considerations, legal defensibility of the practices employed during the S&A processes, the necessity to use the most valid and appropriate assessment methods to ensure the best role-applicant fit, and performance goals, number of the challenges faced by occupational psychologists did not only increase, but the nature of challenges also became more complicated in contemporary S&A practices.

It should be noted that the S&A is a dynamic and iterative process and best practice selection is subject to observing the contemporary changes in the pool of workers (e.g. diversity, skills and expectations of new generations), human capital requirements of firms which lead occupational psychologists to develop appropriate competency models including modified job descriptions and person specifications. Furthermore, assessment methods that are abundant in the HR area are not exclusive to selection and assessment and they can be used in other functions of HR such as training and development. However, perhaps the optimum combination and mix of different tools to address the contextual S&A requirement underlies the most significant contribution expected from occupational psychologists.

REFERENCES

- Becker, B., & Huselid, M. (2006). Strategic Human Resources Management. Where Do We Go From Here?. *Journal of Management*, 32(6): 898–925.
- Burke, R. J., & Cooper, C. L. (2006). The New World of Work and Organizations: Implications for Human Resource Management. *Human Resource Management Review*, 16(2): 83-85.
- Choi, S., & Rainey, H. G. (2010). Managing Diversity in US Federal Agencies: Effects of Diversity and Diversity Management on Employee Perceptions of Organizational Performance. *Public Administration Review*, 70(1): 109-121.
- Coff, R., & Kryscynski, D. (2011). Drilling for Micro-Foundations of Human Capital-Based Competitive Advantages. *Journal of Management*, 37(5), 1429–1443.
- Cook, M. (2016). *Personnel Selection: Adding Value Through People-A Changing Picture*. John Wiley & Sons.
- Cousans, F. (n.d.). Presentation for a Lecture on Psychological Assessment at Work, Unit 4 Diversity & Social Mobility. Personal Collection of F. Cousans, University of Leicester, Leicester, UK.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Dainty, A. R., & Lingard, H. (2006). Indirect Discrimination in Construction Organizations and The Impact on Women's Careers. *Journal of Management in Engineering*, 22(3), 108-118.
- Dunleavy, E., Morris, S., & Howard, E. (2015). Measuring Adverse Impact in Employee Selection Decisions. In C. Hanvey & K. Sady (Eds.), *Practitioner's Guide to Legal Issues in Organizations* (pp. 1-26). Cham, Switzerland: Springer International Publishing.
- Gilliland, S. W. (1993). The Perceived Fairness of Selection Systems: An Organizational Justice Perspective. *Academy of Management Review*, 18(4), 694-734.
- Harvey, R. J., & Wilson, M. A. (2000). Yes Virginia, There is an Objective Reality in Job Analysis. *Journal of Organizational Behavior*, 21(7), 829-854.
- Herriot, P. (2004). Social Identities and Applicant Reactions. *International Journal of Selection and Assessment*, 12(1-2), 75-83.
- Kausel, E. E., Culbertson, S. S., & Madrid, H. P. (2016). Overconfidence in Personnel Selection: When and Why Unstructured Interview Information Can Hurt Hiring Decisions. *Organizational Behavior and Human Decision Processes*, 137, 27-44.
- Koch, A. J., D'Mello, S. D., & Sackett, P. R. (2015). A Meta-Analysis of Gender Stereotypes and Bias in Experimental Simulations of Employment Decision Making. *Journal of Applied Psychology*, 100(1), 128.
- Koczwara, A. & Ashworth, V. (2013). Selection and Assessment. In R. Lewis & L. Zibarras (Eds.), *Work and Occupational Psychology; Integrating Theory and Practice* (pp. 295-342). Sage.
- Lievens, F., & Patterson, F. (2011). The Validity and Incremental Validity of Knowledge Tests, Low-Fidelity Simulations, and High-Fidelity Simulations for Predicting Job Performance in Advanced-Level High-Stakes Selection. *Journal of Applied Psychology*, 96(5), 927.
- Marcus, B., Goffin, R. D., Johnston, N. G., & Rothstein, M. G. (2007). Personality and Cognitive Ability as Predictors of Typical and Maximum Managerial Performance. *Human Performance*, 20(3), 275-285.
- McKinney, A. P., Carlson, K. D., Mecham, R. L., D'angelo, N. C., & Connerley, M. L. (2003). Recruiters' use of GPA in Initial Screening Decisions: Higher GPAs Don't Always Make the Cut. *Personnel Psychology*, 56(4), 823-845.
- Morgeson, F. P., & Dierdorff, E. C. (2011). Work Analysis: From Technique to Theory. In S. Zedeck (Ed.), *APA Handbook of Industrial and Organizational Psychology* (pp. 3-41). Washington, DC: American Psychological Association.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Morgeson, F. P., Campion, M. A., Dipboye, R. L., Hollenbeck, J. R., Murphy, K., & Schmitt, N. (2007). Are We Getting Fooled Again? Coming to Terms With Limitations in The Use of Personality Tests For Personnel Selection. *Personnel Psychology*, 60(4), 1029-1049.
- Morgeson, F. P., Delaney-Klinger, K., Mayfield, M. S., Ferrara, P., & Campion, M. A. (2004). Self-Presentation Processes in Job Analysis: A Field Experiment Investigating Inflation in Abilities, Tasks, and Competencies. *Journal of Applied Psychology*, 89(4), 674-686.
- Morgeson, F. P., Spitzmuller, M., Garza, A. S., & Campion, M. A. (2016). Pay Attention! The Liabilities of Respondent Experience and Carelessness When Making Job Analysis Judgments. *Journal of Management*, 42(7), 1904-1933.
- Newman, D. A., & Lyon, J. S. (2009). Recruitment Efforts to Reduce Adverse Impact: Targeted Recruiting for Personality, Cognitive Ability, and Diversity. *Journal of Applied Psychology*, 94(2), 298-317.
- Ng, E. S., & Burke, R. J. (2005). Person-organization Fit and The War For Talent: Does Diversity Management Make A Difference?. *The International Journal of Human Resource Management*, 16(7), 1195-1210.
- O'Connell, M., Kung, M. & Wolf, M.S. (2014). Understanding Adverse Impact in The Hiring Process. Select International Whitepaper.
- Ones, D. S., Viswesvaran, C., & Dilchert, S. (2005). Cognitive Ability in Personnel Selection Decisions. In A Evers, O. Vockuijl & N. Anderson (Eds.), *Handbook of Personnel Selection* (pp. 143-173). Oxford: Blackwell.
- Oswald, F. L. (2003). Job Analysis: Methods, Research, and Applications for Human Resource Management in The New Millennium. *Personnel Psychology*, 56(3), 800–802
- Patterson, F., Zibarras, L., Carr, V., Irish, B., & Gregory, S. (2011). Evaluating Candidate Reactions to Selection Practices Using Organisational Justice Theory. *Medical Education*, 45(3), 289-297.
- Phillips, J. M., & Gully, S. M. (2002). Fairness Reactions to Personnel Selection Techniques in Singapore and The United States. *International Journal of Human Resource Management*, 13(8), 1186-1205.
- Posthuma, R. A., Campion, M. C., Masimova, M., & Campion, M. A. (2013). A High Performance Work Practices Taxonomy: Integrating the Literature and Directing Future Research. *Journal of Management*, 39(5), 1184-1220.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Roth, P. L., Bevier, C. A., Bobko, P., Switzer, F. S., & Tyler, P. (2001). Ethnic Group Differences in Cognitive Ability in Employment and Educational Settings: A Meta-Analysis. *Personnel Psychology*, 54(2), 297-330.
- Sackett, P. R., & Ellingson, J. E. (1997). The Effects of Forming Multi-Predictor Composites on Group Differences and Adverse Impact. *Personnel Psychology*, 50(3), 707-721.
- Sackett, P. R., & Laczko, R. M. (2003). Job and Work Analysis. In W. C. Borman, D. R. Ilgen, & R. J. Klimoski (Eds.), *Handbook of Psychology: Industrial and Organizational Psychology* (vol. 12: pp. 21-37). New York: John Wiley.
- Sanchez, J. I., & Levine, E. L. (2012). The Rise and Fall of Job Analysis and The Future of Work Analysis. *Annual Review of Psychology*, 63: 397-425.
- Schmidt, F. L., & Hunter, J. E. (1998). The Validity and Utility of Selection Methods in Personnel Psychology: Practical and Theoretical Implications of 85 Years of Research Findings. *Psychological Bulletin*, 124(2): 262.
- Schmitt, N., & Chan, D. (1998). *Personnel Selection: A Theoretical Approach*. London: Sage.
- Searle, R. H. (2003). *Selection & Recruitment: A Critical Text*. Milton Keynes, UK: Palgrave Macmillan.
- Truxillo, D. M., Steiner, D. D., & Gilliland, S. W. (2004). The Importance of Organizational Justice in Personnel Selection: Defining When Selection Fairness Really Matters. *International Journal of Selection and Assessment*, 12(1-2): 39-53.
- Wanous, J. P. (1992). *Organizational Entry: Recruitment, Selection, Orientation and Socialization of Newcomers*. New Jersey: Prentice Hall.

**CORPORATE SOCIAL RESPONSIBILITY AS A SOURCE OF GROWTH AND
SUSTAINABILITY: A THEMATIC ANALYSIS**

Dr. Meltem Yavuz*
Prof. Dr. Rifat Kamaşak**

ABSTRACT

The role of corporate social responsibility (CSR) in sustainability is unquestionable, particularly for developing countries which will play important roles in social development of the world as well as they do in business markets. Besides, CSR practices on the way of maintaining a continuing organisational development and growth are a must for many firms. Therefore, it is imperative that organisations engage in social and environmental practices and integrate them to their strategic plans to achieve a sustainable growth and development. This study aims to investigate an airline company's socially responsible practices for its long-term sustainability through examining the company's published Sustainability Report in 2017. The data which were collected from the Sustainability Report were analysed by a thematic analysis. In accordance with the CSR literature, the study found environment, economy and society-based practices as the most important CSR initiatives.

Keywords: *Corporate social responsibility, Sustainability, Competitiveness, Thematic analysis*

JEL Codes: *M10, M14, M19*

1. INTRODUCTION

Over the last twenty years, the term “sustainable development” has attracted considerable attention in business and society. Sustainable development is still a relatively new concept with several unknowns for many firms and business executives, especially for developing countries. However, it is imperative that organisations engage in social and environmental practices and integrate them to their strategic plans to achieve a sustainable growth and development (Juholin, 2004). Many firms which especially operate in airlines, chemicals, textile, construction and mining industries may generate harmful effects to environment, thus they are subject to rigorous environmental checks enacted by the governments and local authorities. Apart from the necessity to obey the legal requirements, industries that are considered as environmentally hazardous may also need to address the pressure created by

* Istanbul University, Istanbul, Turkey, meltem.yavuz@istanbul.edu.tr

** Bahcesehir University, Istanbul, Turkey, rifat.kamasak@eas.bau.edu.tr

stakeholders. Therefore, socially responsible practices on the way of maintaining a sustainable organisational development are a must for many firms (Cowper-Smith & de Grosbois, 2011).

Corporate Social Responsibility (CSR) can be defined as “the continuing commitment by business to behave ethically and contribute to economic development while improving the quality of life of the workforce and their families as well as the local community and society at large” (WBCSD, 1999, p. 3). According to Mellahi et al. (2016), CSR refers to “corporate actions that appear to advance some social good that allows a firm to enhance organisational performance, regardless of motive” (p. 144). CSR has different dimensions and the environment, economy and society are the ones that are mostly mentioned in the literature (WBCSD, 1999; Hooper & Greenall, 2005; Cowper-Smith & de Grosbois, 2011).

This study aims to investigate an airline company’s socially responsible practices for its long-term sustainability through examining the company’s published Sustainability Report in 2017. The name of the company will not be kept confidential since it is open to public and everyone can reach to general and financial information about it. Turkish Airlines which operates scheduled flights all around the world is recognised among the the most valueable brands in Turkey. The company which has earned \$175 millions net profits in 2017 has also 24075 employees (Turkish Airlines, 2017). It is well-known by its sustainability practices and is generally considered as a role model in the Turkish civil aviation industry by the other competitors. The airline industry in Turkey is critically important because of the role it plays in the sustainable growth and development efforts of tourism industry, and in the creation of significant economic impact, job opportunities and social benefits (Graham & Shaw, 2008). Against these mentioned benefits, some negative outcomes such as climate change, air pollution, noise pollution, biodiversity loss, waste generation and other environmental issues are unavoidable and these are concerned as the most notable negative effects of the airline industry (Daley, Dimitriou, & Thomas, 2008; Cowper-Smith & de Grosbois, 2011). Therefore, resulting from the high growth in the airline transport traffic volume, an increasing pressure from the related authorities on the companies operating in the airline industry to adopt sustainability practices can be seen (IATA, 2016).

2. RESEARCH METHODOLOGY

The research was designed to identify “*which organisational initiatives for sustainability are used by Turkish Airlines?*” The data were collected from the published Sustainability Report (free-standing and available online) in 2017 (Turkish Airlines, 2017). In order to analyse the data, a thematic analysis was used as the primary analysis method. A six-staged thematic analysis method suggested by Braun and Clarke (2006) that comprises the stages: familiarising with data, generating initial codes, searching for themes, reviewing themes, defining-naming themes and producing the report, was followed.

Phase 1

The 57-page Sustainability Report was read multiple times and major patterns that shape the whole meanings were identified before moving to the coding stage as recommended (Nowell et al., 2017). During this phase, a number of notes about the ideas for initial coding (Braun & Clarke, 2006) were taken and the authors focused on the raw data to fully concentrate on the specific topic and to achieve an in-depth thinking on the research question.

Phase 2

Having familiarised with the data, the coding stage started (Braun & Clarke, 2006). The main purpose of data coding is to reduce, organise, and compare the large amount of data in hand (Creswell, 2014; O'Reilly et al., 2012). "Data collection process may yield a large amount of data that can lead to the danger of drowning in data" (Kamasak et al., 2017). For this reason, the researchers followed a systematic coding process that breaks the huge amount of data down into smaller sections (Saunders et al., 2012; Strauss & Corbin, 1998). Apart from that, the frequency of word repetitions was counted and one hundred and twenty-eight codes which related to the issue of sustainability emerged from the full report according to their iteration frequencies. The frequencies in relation to similar meanings and common words were shown in Table 1 below.

Table 1. The Frequencies Of Words

| F* | Codes | F* | Codes | F* | Codes | F* | Codes |
|-----------|-----------------|-----------|--------------|-----------|--------------|-----------|---------------|
| 136 | employees | 31 | noise | 13 | rights | 7 | source |
| 129 | safety | 31 | increase | 13 | requirements | 7 | priorities |
| 112 | management | 30 | audit | 13 | natural | 7 | participation |
| 110 | customer | 28 | regulations | 13 | gender | 7 | implement |
| 107 | training | 28 | members | 12 | quality | 7 | female |
| 96 | fuel efficiency | 27 | improvement | 12 | procedures | 7 | economy |
| 91 | sustainability | 26 | support | 12 | initiatives | 7 | dedicated |
| 77 | social | 26 | standards | 12 | future | 7 | competitive |
| 76 | corporate | 25 | ethics | 12 | capacity | 7 | commitment |
| 66 | passengers | 23 | practices | 12 | age | 7 | bribery |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | | | | | | |
|----|----------------|----|-----------------|----|--------------|---|----------------|
| 64 | economic | 23 | change | 11 | strategy | 7 | agreements |
| 57 | satisfaction | 22 | value | 11 | shareholders | 6 | trust |
| 56 | environmental | 22 | policy | 11 | minimize | 6 | strategic |
| 55 | security | 22 | engagement | 11 | brand | 6 | solutions |
| 55 | efficiency | 21 | climate | 10 | rules | 6 | renewed |
| 55 | carbon | 20 | water | 9 | together | 6 | leadership |
| 53 | stakeholders | 20 | consumption | 9 | priority | 6 | human |
| 53 | health | 20 | awards | 9 | policies | 6 | greenhouse |
| 52 | risk | 19 | culture | 9 | paper | 6 | certified |
| 51 | waste | 18 | continuous | 9 | globally | 6 | assurance |
| 50 | world | 17 | footprint | 9 | ensuring | 5 | workforce |
| 50 | environment | 17 | ethical | 9 | efficient | 5 | technology |
| 45 | responsibility | 17 | awareness | 9 | career | 5 | tax |
| 44 | new aircraft | 16 | people | 8 | saved | 5 | society |
| 43 | waste | 15 | success | 8 | respect | 5 | participants |
| 40 | performance | 15 | reduction | 8 | recycling | 5 | maintain |
| 40 | emissions | 15 | employment | 8 | needs | 5 | innovation |
| 36 | governance | 15 | communication | 8 | investments | 5 | infrastructure |
| 36 | financial | 15 | code | 8 | generation | 5 | identification |
| 35 | development | 14 | investor | 8 | cost | 5 | electricity |
| 32 | growth | 14 | gdp | 7 | team | 5 | disabilities |
| 32 | contribution | 14 | anti-corruption | 7 | strengths | 5 | collaboration |

*F: Frequency

Phase 3

“Themes are identified by bringing together components or fragments of ideas or experiences, which often are meaningless when viewed alone” (DeSantis & Ugarriza, 2000, p. 362). In the third phase, considering their connections with the research objectives, the initial codes that might have relationships with the phenomena, central concepts and categories were generated by the frequencies and meanings of the words in order to extract themes. As King (2004) suggested, using predefined codes was the best place to start this analysis. In order to see the thematic synthesis of codes, the authors decided to employ word clouds method which provides researchers a holistic appearance of the themes based on the frequencies of the words occurring in the source text (Tong et al., 2012). Word clouds method is accepted as a static way of summarising a text with a thorough and appealing visualisation that includes the most recurring themes in the study (Heimerl et al., 2014). They provide an overview by distilling text down to those words that appear with the highest frequency. The word cloud for this study is below.

Figure 1. The Word Cloud of The Study



Note: The word cloud was generated through <https://www.wordclouds.com/>

Phase 4

In order to review the themes, a deductive approach was used in this study. Therefore, a more detailed analysis for understanding several aspect of the data was conducted (Braun & Clarke, 2006). Sustainability initiatives were identified based on the data obtained from the Sustainability Report of

Turkish Airlines and the initiatives were classified into a framework which consists of the three predetermined CSR dimensions of the World Business Council for Sustainable Development that are, environment, economy and society (WBCSD, 1999). However, after the collation process, the analysis yielded two more potential themes that can be termed as “ethical-based” and “management-based” initiatives for sustainability. These themes are depicted in Table 2.

Table 2. The Potential Themes and Codes Identified

| Potential Themes | Codes |
|-------------------------|---|
| Ethical-based | rights, requirements, priorities, ethics, bribery, agreements, trust, value, ethical, awareness, responsibility, code, anti-corruption |
| Economy-based | improvement, economy, competitive, capacity, economic, continuous, efficient, tax, investments, generation, cost, infrastructure, financial, development, growth, contribution, gdp |
| Society-based | employees, safety, audit, regulations, members, customer, training, gender, female, social, corporate, passengers, future, commitment, satisfaction, shareholders, policy, engagement, security, leadership, human, together, stakeholders, health, risk, culture, world, workforce, career, society, participants, people, respect, employment, needs, governance, investor, disabilities, collaboration |
| Environment-based | noise, increase, source, natural, fuel efficiency, sustainability, support, age, environmental, minimize, solutions, renewed, efficiency, carbon, climate, water, consumption, greenhouse, paper, waste, footprint, environment, new aircraft, waste, saved, reduction, recycling, emissions, electricity |
| Management-based | management, participation, implement, quality, procedures, initiatives, dedicated, standards, practices, change, strategy, success, performance, strategic, priority, policies, certified, assurance, globally, ensuring, technology, maintain, innovation, communication, identification, team, strengths, awards, brand |

Phase 5

The final re-read of the report to determine whether the potential themes captured the most important and relevant elements of data in relation to the research question (Braun & Clarke, 2012, p. 9) was done

in this phase. During the fifth phase, the authors integrated their personal insights into the research findings to ensure that all aspects of the data were thoroughly analysed (Nowell et al., 2017: 10). The final themes were organised until the authors were satisfied that all data were displayed in a meaningful and useful manner. The initiatives implemented by Turkish Airlines in order to contribute to its sustainability efforts were organised into five themes. They are termed and defined as:

Understanding Ethical Conduct: Ethical operating and trading adaptations and dedicated values of the company.

Economic Proactivity: Dynamic and flexible financial planning process implementations of the company for struggling with changing and competitive economy.

Engagement of Shareholders: The initiatives provided by the company to provide community well-being, employee empowerment, stakeholder satisfaction, customer loyalty and commitment etc.

Respect for Environment: The goals and initiatives implemented by the company to mitigate or reduce environmental damage.

Integrate Strategic Priorities: The strategic implementations of the company to improve customer service, productivity, efficiency and workplace environments.

3. CONCLUSION

In parallel to the existing literature which states that CSR initiatives should include environment-based, economy-based and society-based solutions and goals (WBCSD, 1999; Hooper & Greenall, 2005; Cowper-Smith & de Grosbois, 2011), this paper confirms the previous findings: Besides, a couple of new initiatives that were not mentioned in the framework of the World Business Council for Sustainable Development were uncovered that were ethical-based and management-based initiatives. Therefore, this study contributes, enhances and extends the existing CSR initiatives literature. Emergence of new findings might be related to the business dynamics and context of the country. As such, it is unfortunately evident that several unethical and illegal practices are tolerated by firms and local and government institutions, and bribing in different forms is not totally welcomed but is considered as a norm in society. In relation to this, Turkish Airlines might particularly need to emphasise the importance of ethical-based initiatives in their report. Furthermore, the lack of managerial systems that can both increase the economic efficiency and curtail corruption and unethical conduct, thus contributing to sustainability is also evident in the country. One explanation for the finding regarding the necessity of management-based sustainability initiation might be linked to this situation and the company might try to highlight this necessity as well.

REFERENCES

Braun, V., & Clarke, V. (2006). Using Thematic Analysis in Psychology. *Qualitative Research in Psychology*, 3: 77–101.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Braun, V., Clarke, V., & Terry, G. (2012). Thematic Analysis. In H. Cooper, P. M. Camic, D. L. Long, A. T. Panter, D. Rindskopf, & K. J. Sher (EDS), *APA Handbook of Research Methods in Psychology*, 2: 57-71. Washington, DC: American Psychological Association.
- Cowper-Smith, A., & de Grosbois, D. (2011). The Adoption of Corporate Social Responsibility Practices in The Airline Industry. *Journal of Sustainable Tourism*, 19(1): 59-77.
- Creswell, J. W. (2014). *Research design: Qualitative, quantitative, and mixed method approaches* (4th ed.). Thousand Oaks, CA: Sage Publications.
- Daley, B., Dimitriou, D., & Thomas, C. (2008). The Environmental Sustainability of Aviation and Tourism. In A. Graham, A. Papatheodorou & P. Forsyth (Eds.), *Aviation and Tourism: Implications for Leisure Travel*: 239–253. Aldershot, UK: Ashgate.
- DeSantis, L., & Ugarriza, D. (2000). The Concept of Theme as Used in Qualitative Nursing Research. *Western Journal of Nursing Research*, 22: 351–372.
- Graham, B., & Shaw, J. (2008). Low-cost Airlines in Europe: Reconciling Liberalization and Sustainability. *Geoforum*, 39(3): 1439-1451.
- Heimerl, F., Lohmann, S., Lange, S., & Ertl, T. (2014, January). Word Cloud Explorer: Text Analytics Based on Word Clouds. In *System Sciences (HICSS), 2014 47th Hawaii International Conference on IEEE*. 1833-1842.
- Hooper, P.D., & Greenall, A. (2005). Exploring The Potential for Environmental Performance Benchmarking in The Airline Sector. *Benchmarking*, 12: 151–165.
- IATA. (2016). *Future of The Airline Industry 2035*. Available at: <https://www.iata.org/policy/Documents/iata-future-airline-industry.pdf> [accessed: 10 May 2018].
- Juholin, E. (2004). For Business or for The Good of All? A Finnish Approach to Corporate Social Responsibility. *Corporate Governance*, 4: 20–32.
- Kamasak, R., Kar, A., Yavuz, M., & Baykut, S. (2017). Qualitative Methods in Organizational Research: An Example of Grounded Theory Data Analysis. In *Handbook of Research on Organizational Culture and Diversity in The Modern Workforce* (pp. 23-42). IGI Global.
- Lynes, J. K., & Dredge, D. (2006). Going Green: Motivations for Environmental Commitment in the Airline Industry. A Case Study of Scandinavian Airlines. *Journal of Sustainable Tourism*, 14(2): 116-138.
- Mellahi, K., Frynas, J.G., Sun, P., & Siegel, D. (2016). A Review of the Nonmarket Strategy Literature: Toward a Multi-Theoretical Integration. *Journal of Management*, 42(1): 143–173.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Nowell, L. S., Norris, J. M., White, D. E., & Moules, N. J. (2017). Thematic Analysis: Striving to Meet The Trustworthiness Criteria. *International Journal of Qualitative Methods*, 16(1): 1-13.

O'Reilly, K., Paper, D., & Marx, S. (2012). Demystifying Grounded Theory for Business Research. *Organizational Research Methods*, 15(2): 247–262.

Saunders, M., Lewis, P., & Thornhill, A. (2012). *Research Methods for Business Students* (6th ed.). Essex, UK: Pearson Education.

Strauss, A. L., & Corbin, J. (1998). *Basics of Qualitative Research: Techniques and Procedures for Developing Grounded Theory*. London: Sage Publications.

Tong, A., Flemming, K., McInnes, E., Oliver, S., & Craig, J. (2012). Enhancing Transparency in Reporting the Synthesis of Qualitative Research: ENTREQ. *BMC Medical Research Methodology*, 12(1): 181.

Turkish Airlines (2017). Retrieved from Sustainability Report. Available at: http://investor.turkishairlines.com/documents/ThyInvestorRelations/download/yillik_raporlar/surdurulebilirlik-raporu-en-2017.pdf [accessed: 10 May 2018].

World Business Council for Sustainable Development. (1999). *Corporate Social Responsibility: Meeting Changing Expectations*. Available at: <http://www.wbcsd.org/DocRoot/hbdf19Txhmk3kDxBQDWW/CSRmeeting.pdf> [accessed: 18 May 2018].

**YEREL YÖNETİMLERDE HALKLA İLİŞKİLER PROJELERİ: İZMİR'İN İLÇE
BELEDİYELERİNE YÖNELİK BİR ANALİZ**

Mikail BATU*

Şehriban KAYACAN**

ÖZET

Ülke yönetimlerinin en küçük birimlerinden biri olan belediyeler, sorumlu oldukları bölge halkının ihtiyaçlarını gidermek amacıyla olanakları çerçevesinde etkili çalışmaktadır. Belediyeler yaptıkları yenilikçi çalışmalar ile halkın yaşam standartlarını yükseltmekte, sosyal hayata değer katarak kurumsal vatandaşlıklarını gerçekleştirmektedir. Ayrıca buldukları bölgelerde düzenledikleri projeler ile halka doğrudan maddi ve manevi fayda sağlayabilmekte ve halk ile ilişkilerini etkileşim çerçevesinde sürdürmektedir. Bu bağlamda halktan kopmadan, onların beklentilerine yanıt vermek için çeşitli projeler geliştirilmektedir. Bu çalışmada belediyelerin yaptıkları çalışmalar projeler ile kısıtlanmış ve İzmir ilindeki altı ilçe projelerinin nasıl algılandığını ortaya koymaktır. Belediyelerde görüşme yapılan halkla ilişkiler sorumluları ile halkla ilişkiler projelerine yönelik derinlemesine görüşmeler yapılmış ve yapılan projelerin nasıl algılandıkları belirlenmeye çalışılmıştır. Elde edilen verilerin değerlendirme sonuçlarına göre halkla ilişkiler projelerinin, benzerlik ve farklılıkları ortaya konulmuş ve birtakım önerilerde bulunulmuştur.

Anahtar Kelimeler: *Belediyeler, Yerel Yönetimler, Halkla İlişkiler Projeleri, İzmir'deki İlçe Belediyeleri.*

**PUBLIC RELATION PROJECTS IN LOCAL GOVERNMENTS: AN ANALYSIS FOR
DISTRICT MUNICIPALITIES IN İZMİR**

ABSTRACT

Municipalities, one of the smallest units of the governments, effectively work to meet the needs of the people in their region within the framework of their capacity. The municipalities raise the standard of living of the people with the innovative works and create their corporate citizenship by adding value to social life. In addition to that, they can directly provide material and spiritual benefits to the people with their projects and continue to interact with them. In this context, various projects have been

* Doç.Dr., Ege Üniversitesi, İletişim Fakültesi, Halkla İlişkiler, Kurumsal İletişim Anabilim Dalı Öğretim Üyesi, mikail.batu@ege.edu.tr

** CeyBer Çağrı Merkezi, İç İletişim Uzmanı, sehriban.kayacan@hotmail.com

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

developed to respond to their expectations without breaking away from people. In this study, the works of the municipalities are restricted with the projects and 6 district municipalities in İzmir province are examined as a sample. The aim of the study is to show how the public relations projects carried out by 6 municipalities are perceived. In-depth interviews are done with public relations specialists, and it is tried to determine how these projects are perceived. According to the evaluation results of the data, similarities and differences of the public relations projects are indicated, and some suggestions are made.

Keywords: *Municipalities, Local Governments, Public Relations Projects, District Municipalities in İzmir.*

1.GİRİŞ

Belediyeler devlete bağlı ve tüzel kişiliği olan örgütler olarak bilinmektedir. Bulunduğu bölgenin hızla gelişmesine katkı sağlamak ve bölge halkının daha iyi şartlarda hayatlarını sürdürmesine olanak tanımak için çalışan belediyeler, buldukları yerin temizlik, aydınlatma, su, sağlık hizmetleri, toplu taşıma gibi kamu hizmetleri ile ilgilenmekle yükümlüdür. Geçmişte hizmet alanlarının daha az olduğu görülen belediyelerin günümüzde hızlı kentleşmenin etkisi ile sunduğu hizmetlerin çeşitliliği artmaktadır. Kamuoyuna hizmet sunmak için var olan belediyelerin hizmet çeşitliliğinin fazlaşması durumuna bağlı olarak, halkla ilişkiler biriminin de önemi artmaktadır. Yerel yönetimlerin ve halkla ilişkiler çalışmalarının temel amacı hedef kitle ile etkili iletişim kurmaktır. Belediye ve halk arasında köprü görevi görerek iletişimin etkili şekilde gerçekleşmesini sağlayan halkla ilişkiler sorumluları hem belde sakinlerinin ihtiyaçlarının belediyeye iletilmesinde hem de belediyenin yaptığı çalışmaların kamuya ulaşmasında sorumluluk almaktadır. Yerel yönetimlerin hedef kitlesi olan yerel halkın beklentilerini ve ihtiyaçlarını karşılamak amacıyla çalışmalarını gerçekleştiren belediyelerin başarılı olabilmek için bu kitleyi iyi analiz etmesi gerekmektedir. Halkın oyları ile seçilen belediyeler, talepleri ve beklentileri gerçekleştirmek için çaba harcamaktadır. Belediyeler yaptıkları çalışmalar ve projeler ile halkın yaşam standartlarını yükseltmek kurumsal vatandaşlıklarını gerçekleştirmektedir. Bu çalışmalar ve projelere devamlılığı sağlamak da çalışma ve projelere katılımları ile destek veren “aktif vatandaşlarla” mümkündür. Bu durumda belediyeler, halktan kopmadan, onların ihtiyaçlarına ve beklentilerine yanıt verebilecek güçte olmaktadır. Yerel yönetimlerin en küçük birimlerinden biri olan belediyeler için ihtiyacın ötesinde bir zorunluluk haline gelen halkla ilişkiler projeleri, ihtiyaca yönelik konular saptanarak gerçekleştirilmektedir. Bu çalışma, iletişim temelinde belediyelerin gerçekleştirmiş oldukları halkla ilişkiler projelerini ele alarak değerlendirmektedir. Bu doğrultuda İzmir’de bulunan altı ilçe belediyesinin yaptığı halkla ilişkiler projeleri mercek altına alınmış ve birtakım çıkarımlarda bulunulmuştur.

2.ÇALIŞMANIN ARDALANI

Yerel yönetimler halka en yakın kamu kuruluşlarıdır. Halka fayda sağlamak amacıyla çalışan bu kurum ve kuruluşların amacı halka en iyi hizmeti sunmak, hizmet verdiği halkın bu çalışmalardan mutlu olmasını sağlamak, halkı çeşitli konularda eğitmek ve bilinçlendirmek, halka fayda sağlayacak faaliyetler gerçekleştirmektir. Yerel yönetimler amaçlarını gerçekleştirebilmek ve halk ile işbirliği içerisinde olabilmek için halkla ilişkilerden yardım almaktadır (Özer, 2013:19-50). Halkla ilişkiler çalışmaları, toplumda olumlu bir imaj ve itibar yaratmak, hedef kitlenin desteğini ve ilgisini kazanmak açısından önem taşımaktadır. Yerel yönetimlerde halkla ilişkilerin temel amacı, yönetim ve halk arasındaki bilgi akışının devamlılığını sağlamak ve karşılıklı istek ve ihtiyaçların belirlenip giderilmesi yönünde çalışmalar yapmaya olanak sağlamaktır (Kazancı, 1997: 58). Planlı faaliyetleri kapsayan bir uygulama alanı olan halkla ilişkilerde, iletişim teknikleri çok güçlü ve etkili bir şekilde kullanılmaktadır. Yerel yönetimler halkla ilişkilerin gücünden faydalanarak halkın güvenini sağlamayı amaçladığında başarıyı yakalayabilmektedir. Halkın kendisine duyduğu inanç ve sadakat sayesinde yöneten ve yönetilen arasındaki ilişkiler kuvvetlenmektedir. Kamu yönetiminde halkla ilişkilerin amaçları aşağıdaki gibi açıklanmaktadır (Mıhçıoğlu,1992:186):

Kamuoyunu aydınlatmak, örgütü ve onun izlediği hizmet politikalarını benimsemek,

Halkta yönetime karşı olumlu tutum oluşturmak,

Halkın yönetimle olan ilişkilerinde işini kolaylaştırmak,

Yerinde kararlar alabilmek için halktan bilgi sağlamak,

Yasaklarla ilgili halkı aydınlatarak, halkın yasaklara uymasını sağlamak,

Hizmetlerin görülmesinde halkın işbirliğini sağlamak,

Yasaklarla ilgili halkı aydınlatarak, halkın yasaklara uymasını sağlamak,

Hizmetlerin görülmesinde halkın işbirliğini sağlamak,

Yasalardaki ve yönetsel yöntemlerdeki aksaklıkların saptanması ve giderilmesinde halkın beklentilerinden, şikâyetlerinden faydalanmak.

Yerel yönetimlerde halkla ilişkiler hedef kitle olan halkın ihtiyaçlarının belirlenmesi, kurumdan beklentilerinin dikkate alınması ve kurumun yaptığı hizmet ve projelerde halkla işbirliğinin sağlanması olarak tanımlanmaktadır (Yalçındağ, 1996:5-6). Halkla ilişkiler yerel yönetimlerde yönetimin işleyişinin iyileştirilmesi ve geliştirilmesi için çalışmaktadır. Halkla ilişkilerin en önemli işlevlerinden birisi yönetim işlevidir. İki yönlü iletişim ile hedef ve kaynağın birbirini etkilemesi halkla ilişkileri başarıya götürmektedir. Hem bilgi almayı hem de bilgi vermeyi amaçlayan bu iletişim yönteminde, halkın kendini yaşadığı yer ile bütünleşmesi, halkın yönetime karşı önyargısının oluşmaması ve

verimli hizmet verilmesi amaçlanmaktadır. Düzenli, sürekli, planlı bir biçimde halkın taleplerini yerine getirmeyi amaçlayan yerel yönetimler halkla ilişkiler ile bunu sağlayabilmektedir (Sezer,1996:66-70). Yerel yönetimlerin halkla ilişkiler konusunda gerçekleştirdiği uygulamalar süreklilik ve sistemlilik arz ederek bulunulan bölgede yaşayan halkın güvenini sağlamaktır. Bu güveni de ancak iki yönlü iletişim ile sağlayabilmektedir. Halk yerel yönetimlerin, yerel yönetimler de halkın beklentilerini karşılamaya çalışmaktadır ve böylece yönetim ile halk arasında bir güven duygusu oluşmaktadır (Yalçındağ,1985:131-156). Yerel yönetimlerde halkla ilişkilerin amaçları aşağıdaki maddeler ile açıklanmaktadır(Tortop, 1993: 4; Sumak, 2001: 11):

Vatandaşlara yerel yönetim kuruluşunun hizmet politikaları ve uygulamaları hakkında bilgi vermek,

Yerel yönetim kuruluşlarınca kesin kararlar alınmadan önce önemli yeni projeler hakkında bilgi vermek,

Yerel yönetimin sistemi ile kendi hak ve sorumlulukları konusunda vatandaşları bilgilendirmek,

Vatandaşlık gururunu aşlamak ve geliştirmek.

Yerel yönetimlerde yapılan halkla ilişkiler projeleri bireye, aileye ya da belli bir gruba fayda sağlamak amacıyla yapılmamaktadır. Çalışmaların tamamı halkın geneline hitap edecek şekilde kamu yararını amaçlayarak gerçekleştirilmektedir. Yerel yönetimlerde gerçekleştirilen halkla ilişkiler projelerinden yönetime herhangi bir maddi çıkar ya da kar sağlamak amacı ile değil, halka maddi ya da manevi destek sağlamak amacıyla yapılmaktadır. Yerel yönetimlerde yapılan çalışmalarda halkın yararı düşünülerek yapılıyor ise halkla ilişkiler projelerinde de aynı amaçlar düşünülmektedir. Ayrıca yerel yönetimlerde halkla ilişkiler projeleri gerçekleştirilirken halkın katılımının sağlanması gerekmektedir. Yerel halkın yapılan projelerde karar alma ve kararları etkileme gücünün olması yapılan projelerin halk tarafından destek görmesi açısından çok önemlidir.

3. YEREL YÖNETİMLERDE HALKLA İLİŞKİLER PROJELERİ: İZMİR'DEKİ İLÇE BELEDİYELERİNE YÖNELİK BİR ANALİZ

3.1. Araştırmanın Amacı ve Sorunsalı

Halkla ilişkiler alanı, 21. yüzyılın değer verilen ilişki yönetiminin temel strateji belirleyicisi olarak görülmektedir. Özel sektörde olduğu gibi yerel yönetimlerde de önemi gün geçtikçe artmaktadır. Bu çalışmanın amacı belediyelerin gerçekleştirmiş oldukları halkla ilişkiler projelerini, iletişim temelinde ele alarak değerlendirmektir.

Çalışmanın sorunsalı, İzmir'deki yerel yönetimlerde halkla ilişkiler projeleri uygulayıcılarının bu projelere yönelik düşüncelerinin ne olduğunu belirlemektir.

3.2. Araştırmanın Modeli

Bu çalışma gerçekleştirilirken betimsel analiz ve görüşme tekniği kullanılmıştır. Nitel araştırma yöntemlerinden biri olan betimsel analizin kullanılma sebebi belediyede (yerel yönetimlerde) çalışan halkla ilişkiler sorumlularının belediyenin yaptığı halkla ilişkiler projeleri hakkındaki görüşlerinin incelenmesidir. Çalışmada elde edilen verilere görüşme tekniği kullanılarak ulaşılmıştır. Karşılıklı konuşma ile gerçekleştirilen görüşme tekniği, aynı konu hakkında farklı insanlar arasındaki görüş paralelliği veya farklılığını saptamak için kullanılmaktadır. Bu teknik sayesinde farklı insanlardan elde edilen verileri karşılaştırma imkânı bulunmaktadır. Ayrıca görüşme tekniği, araştırmacıya zaman esnekliği ve görüşme sırasında konu hakkında ayrıntılı bilgi elde etmeyi sağlamaktadır. Görüşmeci, görüşme sırasında soruların cümle yapısını ve sırasını değiştirebilse de belirli bir forma dayalı olduğu için karşılaştırılabilir bilgi elde edilebilmektedir (Ekinci ve Karakuş, 2011: 1849-1867).

3.3. Araştırmanın Evreni ve Örneklemi

Bu çalışmada araştırmanın evreni olarak İzmir'de bulunan 30 ilçe belediyesi belirlenmiştir. İzmir'de bulunan belediyelerin sıklıkla halkla ilişkiler projeleri ile ilçe sakinlerinin karşısına çıkmaları ve yine sıklıkla basında yer almaları evren olarak seçilme gerekçelerinde önem arz etmektedir.

Araştırmanın örneklemini İzmir'deki altı belediye oluşturmaktadır. Görüşmeyi kabul eden altı belediye; Buca Belediyesi, Karşıyaka Belediyesi, Bornova Belediyesi, Menderes Belediyesi, Bayındır Belediyesi ve Seferihisar Belediyesidir. Diğer Belediyeler iş yoğunluklarını ve günlük iş planlarını çalışmaya katılmama gerekçesi olarak bildirmişlerdir.

3.4. Araştırmanın Kısıtlılığı

Araştırmanın İzmir'de bulunan altı ilçe belediyesindeki proje sorumlularıyla yapılması ve her belediyeden bir kişi ile görüşülmesi bir kısıtlılıktır. Altı ilçe belediyesinin kendilerinin önerdiği belli projelerine yönelik inceleme yapılması da kısıtlılık olarak ele alınabilir.

3.5. Araştırmanın Veri Toplama Yöntemi ve Analizi

Bu çalışmada nitel araştırma yönteminin kullanılma sebepleri arasında konuyu derinlemesine incelemeyi sağlaması ve zengin veri elde etmeye imkân vermesi vardır. Belediyeler hakkında görüşmeye gitmeden önce bilgi sahibi olmak için derinlemesine araştırma yapılmış ve notlar alınmıştır. Devam eden ve tamamlanmış olan halkla ilişkiler projeleri hakkında bilgi sahibi olunmuştur. Araştırmanın örneklemini dâhilinde olan 6 belediyeden proje sorumluları araştırmanın hedef kişileri olarak seçilmiştir. Görüşmeleri gerçekleştirebilmek için sorumlu kişilerden izinler alındıktan sonra randevu alınmış ve el ile not alınacak olmasına rağmen görüşme esnasında ses kaydı yapılacağı bildirilmiştir. Görüşmeye başlamadan önce araştırmanın amacı açıklanmıştır. Görüşmeler 150-180 dakika sürmüştür. Görüşme yapılan kişilerin isteği doğrultusunda konuşmanın bitirilebileceği ve

istemedikleri herhangi bir kaydın silinebileceği vurgulanmıştır. Böylece konuşmacıların daha özgür ve doğru cevaplar vermeleri hedeflenmiştir. Soru ve yanıtı dayalı olarak yapılan görüşmelerde genelden özele 32 soru yöneltilmiştir. Sorular basit, anlaşılır ve birbirini destekleyecek şekilde oluşturulmuştur. Sorular hazırlanırken Yeygel S. ve Yakın M. (2008) “Kurumsal Reklamlarda Göstergeler Aracılığıyla Marka Kimliğinin İletilmesi”; Akkoyunlu G. Ş. ve Kalyoncuoğlu S. (2014) “İşletmelerin Kurumsal Sosyal Sorumluluk Çalışmalarının Marka Algısı Üzerine Etkisinin Değerlendirilmesi” makalelerinden faydalanılmıştır.

3.6. Bulgular

04/04/2017 tarihinde Karşıyaka Belediyesi, 10/04/2017 tarihinde Buca Belediyesi, 12/04/2017 tarihinde Bornova Belediyesi, 18/04/2017 tarihinde Seferihisar Belediyesi, 18/04/2017 tarihinde Menderes Belediyesi, 25/04/2017 tarihinde Bayındır Belediyesi ile görüşmeler gerçekleştirilmiştir. Belediyelerin Halkla İlişkiler Birimlerindeki sorumlular ile yapılan görüşmelere ilişkin genel çerçeve aşağıda soru cevap şeklinde verilmiştir.

Karşıyaka Belediyesi:

Belediyenin halkla ilişkiler projeleri var mı? Aklınıza gelen halkla ilişkiler projeleri nelerdir? Karşıyaka Belediyesinin birçok projesinden bahsedilmiş, akla ilk gelenlerin Karşıyaka Filizleri, Bir Çocuk Bin Gülüş, Hoş Geldin Bebek, Atık Pil olduğu açıklanmıştır.

Projeler basında ne sıklıkla, nasıl haberlerde yer almaktadır? Yerel medya bunların kaçına yer vermektedir? Karşıyaka Belediyesi projeler ile basında sosyal belediyeçilik faaliyetleri ve kültür etkinlikleri ile sık sık yer alındığı belirtilmiştir.

Sosyal medya sitelerinde kaç takipçiniz var? Ne sıklıkla, nasıl içerikler yayınlıyorsunuz? Belediyenin Facebook'ta 28 bin, Instagram'da 15 bin, Twitter'da 22 bin takipçisinin olduğu söylenmiştir. Belediyenin sosyal medya sayfalarından her sabah, bayram ve özel günlerde paylaşım yapıldığı, vefat eden sanatçılar, yazarlar, politikacılar için paylaşımlarda bulunduğu, belediye çalışmalarının aktarıldığı söylenmiştir.

Devam eden proje/projeler var mı? Bu projeler yeterli mi, sayısı artmalı mı? Devam eden projeler olarak Hoş Geldin Bebek, Karşıyaka Filizleri ve Atık Pil isimleri verilmiştir. Bu projeler başarılı olsa da sayılarının artırılması gerektiği düşünülmektedir.

Belediyelerin kısa veya uzun dönemli projeleri var mı? Belediyenin en kısa ve en uzun süren projesi hangisidir? En uzun projenin Karşıyaka Filizleri Projesi olduğu söylenmiş ve genellikle uzun dönemli projeler planlandığı için kısa süren projeler yapılmadığı belirtilmiştir.

Belediyenin proje ekibi var mı, unvanları ve faaliyetleri yeterli mi? Halkla ilişkiler biriminde 58 kişi çalıştığı, her projenin proje uygulayıcı ekibi ve sorumlularının yeterli olduğu söylenmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Proje uygulamalarında hangi aşamaları takip ediyorsunuz? Projeler uygulanırken araştırma, hedef kitle belirleme, geliştirme, uygulama, bütçeleme ve değerlendirme aşamalarının takip edildiği söylenmiştir.

Halkla ilişkiler projelerinin, belediyenin bilinirliğine etkisi var mı? Halkla ilişkiler projelerinin belediyenin bilinirliğine etkisi olduğu düşünülmektedir.

Projelerde başarıyı nasıl ölçüyorsunuz? Projelerde başarının, projelere karşı talebin artması ve bu talebin karşılanabiliyor olması ile ölçümlendiği söylenmiştir.

Projelerin doğmasına hangi koşullar neden olmuştur, projelerin ortaya çıkış amacı halkın ihtiyaçlarını karşılıyor mu? Projelerin halkın maddi ve manevi ihtiyaçlarına karşılık vermek amacıyla gerçekleştirildiği söylenmiş, Karşıyaka Belediyesinde projelerin ortaya çıkış amacının çoğunlukla halkın gereksinimleri olduğu belirtilmiştir.

Halk düzenlenen projelere karşı ilgili mi? Halk projelere neden katılım sağlamak istemektedir? Halkın ilgili olduğu, projelerin maddi ve manevi faydası nedeniyle desteklendiği belirtilmiştir.

Projelerin halkın üzerinde yarattığı etkilerden memnun musunuz? Memnun olduğu belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken yaşanan genel sıkıntılar dikkate alınıyor mu? Herhangi bir sıkıntıda çözüme odaklanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeyle ilgili yaşadığınız herhangi bir kriz veya yaşanan büyük bir sorun var mıdır? Halkın projeler gerçekleştirilirken herhangi bir sıkıntı ile karşılaştığında belediye ile çözüm sürecine gittiği söylenmiştir.

Belediyenizde sorunlar nasıl yönetiliyor? Hemşehri İletişim Merkezi (HİM) ve Whatsapp aracılığı ile halkın şikayetleri belediyeye ulaşmaktadır. Şikayet hangi birim ile alakalı ise o birime yönlendirilmektedir.

Projelerde bütçe ile ilgili sıkıntılar yaşanıyor mu? Maddi sıkıntılar devam etmesine rağmen projelerin devam ettiği belirtilmiştir.

Projelere ilişkin pozitif/negatif geri dönüşler alınıyor mu? Karşıyaka Belediyesi projelere ilişkin olumlu ve olumsuz geri dönüşler almaktadır. Bu geri dönüşleri dikkate alarak projeleri geliştirmek için fırsata dönüştürmektedir.

Belediyenin yürütmekte olduğu projeler hakkında nasıl bilgilendirme yapıyorsunuz? Web sitesi ve sosyal ağların kullanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeniz ne çeşit projelere ağırlık vermektedir? Toplumsal dayanışma, kültür-sanat ve sosyal sorumluluk projelerine ağırlık verildiği belirtilmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Projelerin süresi ne kadar? Her proje için sürenin değiştiği, belediyenin bu konuda esnek davrandığı memnuniyet durumuna göre sürenin uzatılabildiği belirtilmiştir.

Aynı anda birden fazla halkla ilişkiler projesi sürdürülüyor mu? Sürdürüldüğü belirtilmiştir.

Projeler yürütülürken değişiklik yapılıyor mu? Projeler yürütülmeye başlamadan önce hazırlanan planın zaman zaman değişiklik gösterdiği söylenmiştir.

Projelerden en çok kimler yararlanıyor? Yerel halk, öğrenciler, engelliler gibi her projenin hedef kitlesinin farklı olabildiği belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken ortaya çıkan sorunlardan kimler etkileniyor? Projenin hedef kitlesi, belediye çalışanları ve yerel halk etkilenebileceği söylenmiştir.

Projelerin gerçekleştirilmesine karşı çıkan bir kesim var mı? Genellikle halkın projelere destek olduğu ve karşı çıkmadığı belirtilmiştir.

Projeler hakkında farkındalık yaratmak için herhangi bir çalışma yapılıyor mu? Bu tür çalışmaların sosyal medya üzerinden yapıldığı, afişler, billboardlar ve duyurular ile de desteklendiği söylenmiştir.

Projenin sonuçları hakkında hedef kitle, paydaşlar ve kamuoyu bilgilendiriliyor mu? Belediyeye gelenlerle yüz yüze, diğer kitlelere sosyal medya üzerinden bilgilendirme yapıldığı belirtilmiştir.

Projelerin tanınmasını ve hatırlanmasını sağlamak için çalışmalar yapılıyor mu? Proje tarihleri yaklaştığında afişler, duyurular ve sosyal medya üzerinden çalışmalar yapıldığı belirtilmiştir.

Belediyenin internet sitesinden projeler hakkında detaylı bilgiler yer alıyor mu? Detaylı bilgilere ulaşılabileceği belirtilmiştir.

Projelere yenileri eklendiği zaman web sitesinde güncelleme yapılıyor mu? Her yeni proje ile birlikte internet sitesinin projeler kısmının güncellendiği vurgulanmıştır.

Web sitesinde biten projelere yer veriliyor mu? Hem devam eden hem de tamamlanan projelerin web sitesinde yer aldığı söylenmiştir.

Diğer söylenmek istenenler nelerdir? –

Buca Belediyesi:

Belediyenin halkla ilişkiler projeleri var mı? Aklınıza gelen halkla ilişkiler projeleri nelerdir? Buca Belediyesinin birçok projesinden bahsedilmiş, akla ilk gelenlerin Tarık Akan Gençlik Merkezi, Pırlanta Merkezi, Ocaklar Sönmesin Tencereler Kaynasın, Alayına Balayı, Eğitime Zeytin Dalı olduğu açıklanmıştır.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Projeler basında ne sıklıkla, nasıl haberlerde yer almaktadır? Yerel medya bunların kaçına yer vermektedir? Buca Belediyesi projeler ile basında sosyal belediyeçilik faaliyetleri ve kültür etkinlikleri ile sık sık yer aldığı belirtilmiştir.

Sosyal medya sitelerinde kaç takipçiniz var? Ne sıklıkla, nasıl içerikler yayınlıyorsunuz? Belediyenin Facebook'ta 25 bin, Instagram'da 2526 takipçisinin olduğu söylenmiştir. Takip ettiği görülmektedir. Belediyenin sosyal medya sayfalarında güncel çalışmalar, projeler, etkinlikler ve duyurular paylaşılmaktadır. Özel günlerde kutlama mesajları yazılmaktadır.

Devam eden proje/projeler var mı? Bu projeler yeterli mi, sayısı artmalı mı? Devam eden projeler olarak Tarık Akan Gençlik Merkezi, 2. Gençlik Merkezi ve Pırlanta Merkezi isimleri verilmiştir. Bu projeler başarılı olsa da sayılarının artırılması gerektiği düşünülmektedir.

Belediyelerin kısa veya uzun dönemli projeleri var mı? Belediyenin en kısa ve en uzun süren projesi hangisidir? En uzun Tarık Akan Gençlik Merkezi, en kısa Alayına Balayı projelerinin sürdüğü söylenmiştir.

Belediyenin proje ekibi var mı, unvanları ve faaliyetleri yeterli mi? Halkla ilişkiler biriminde 7 kişi çalıştığı, her projenin proje uygulayıcı ekibi ve sorumlularının yeterli olduğu söylenmiştir.

Proje uygulamalarında hangi aşamaları takip ediyorsunuz? Projeler uygulanırken araştırma, uygulama, bütçeleme aşamalarının takip edildiği söylenmiştir.

Halkla ilişkiler projelerinin, belediyenin bilinirliğine etkisi var mı? Halkla ilişkiler projelerinin belediyenin bilinirliğine etkisi olduğu düşünülmektedir.

Projelerde başarıyı nasıl ölçüyorsunuz? Projelerde başarı 6 aylık halk anketleri ile ölçümlendiği söylenmiştir.

Projelerin doğmasına hangi koşullar neden olmuştur, projelerin ortaya çıkış amacı halkın ihtiyaçlarını karşılıyor mu? Projelerin halkın maddi ve manevi ihtiyaçlarına karşılık vermek amacıyla gerçekleştirildiği söylenmiş, Buca Belediyesinde projelerin ortaya çıkış amacının çoğunlukla halkın talepleri doğrultusunda olduğu belirtilmiştir.

Halk düzenlenen projelere karşı ilgili mi? Halk projelere neden katılım sağlamak istemektedir? Halkın ilgili olduğu, projelerin maddi ve manevi faydası nedeniyle desteklendiği belirtilmiştir.

Projelerin halkın üzerinde yarattığı etkilerden memnun musunuz? Memnun olduğu belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken yaşanan genel sıkıntılar dikkate alınıyor mu? Herhangi bir sıkıntıda çözüme odaklanıldığı belirtilmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Belediyeyle ilgili yaşadığınız herhangi bir kriz veya yaşanan büyük bir sorun var mıdır? Halkın projeler gerçekleştirilirken herhangi bir sıkıntı ile karşılaştığında başkan yardımcısının da içinde bulunduğu bir ekip ile çözüm sürecine gittiği söylenmiştir.

Belediyenizde sorunlar nasıl yönetiliyor? Hemşehri İletişim Merkezi (HİM) ile halkın şikayetleri belediyeye ulaşmaktadır. Şikayet hangi birim ile alakalı ise o birime yönlendirilmektedir.

Projelerde bütçe ile ilgili sıkıntılar yaşanıyor mu? Maddi sıkıntılar devam etmesine rağmen projelerin devam ettiği belirtilmiştir.

Projelere ilişkin pozitif/negatif geri dönüşler alınıyor mu? Karşıyaka Belediyesi projelere ilişkin olumlu ve olumsuz geri dönüşler almaktadır. Bu geri dönüşleri dikkate alarak projeleri geliştirmek için fırsata dönüştürmektedir.

Belediyenin yürütmekte olduğu projeler hakkında nasıl bilgilendirme yapıyorsunuz? Web sitesi ve sosyal ağların kullanıldığı belirtilmiştir. İlçe sakinlerini bilgilendirmek için duyurular asıldığı söylenmiştir.

Belediyeniz ne çeşit projelere ağırlık vermektedir? Toplumsal dayanışma, kültür-sanat ve sosyal sorumluluk projelerine ağırlık verildiği belirtilmiştir.

Projelerin süresi ne kadar? Her proje için sürenin değiştiği, belediyenin bu konuda esnek davrandığı memnuniyet durumuna göre sürenin uzatılabildiği belirtilmiştir.

Aynı anda birden fazla halkla ilişkiler projesi sürdürülüyor mu? Sürdürüldüğü belirtilmiştir.

Projeler yürütülürken değişiklik yapılıyor mu? Projeler yürütülmeye başlamadan önce hazırlanan planın zaman zaman değişiklik gösterdiği söylenmiştir.

Projelerden en çok kimler yararlanıyor? Yerel halk, öğrenciler, engelliler gibi her projenin hedef kitlesinin farklı olabildiği belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken ortaya çıkan sorunlardan kimler etkileniyor? Projenin hedef kitlesi, belediye çalışanları ve yerel halk etkilenebileceği söylenmiştir.

Projelerin gerçekleştirilmesine karşı çıkan bir kesim var mı? Genellikle halkın projelere destek olduğu ve karşı çıkmadığı belirtilmiştir.

Projeler hakkında farkındalık yaratmak için herhangi bir çalışma yapılıyor mu? Bu tür çalışmaların afişler, billboardlar ve duyurular ile yapıldığı söylenmiştir.

Projenin sonuçları hakkında hedef kitle, paydaşlar ve kamuoyu bilgilendiriliyor mu? Belediyeyle gelenlerle yüz yüze, diğer kitlelere sosyal medya üzerinden bilgilendirme yapıldığı belirtilmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Projelerin tanınmasını ve hatırlanmasını sağlamak için çalışmalar yapılıyor mu? Proje tarihleri yaklaştığında afişler, duyurular ve sosyal medya üzerinden çalışmalar yapıldığı belirtilmiştir.

Belediyenin internet sitesinden projeler hakkında detaylı bilgiler yer alıyor mu? Detaylı bilgilere ulaşılabileceği belirtilmiştir.

Projelere yenileri eklendiği zaman web sitesinde güncelleme yapılıyor mu? Her yeni proje ile birlikte internet sitesinin projeler kısmının güncellendiği vurgulanmıştır.

Web sitesinde biten projelere yer veriliyor mu? Hem devam eden hem de tamamlanan projelerin web sitesinde yer aldığı söylenmiştir.

Diğer söylenmek istenenler nelerdir? –

Seferihisar Belediyesi:

Belediyenin halkla ilişkiler projeleri var mı? Aklımıza gelen halkla ilişkiler projeleri nelerdir? Seferihisar Belediyesinin birçok projesinden bahsedilmiş, akla ilk gelenin Mavi Bayrak Projesi (Citta Slow) olduğu açıklanmıştır.

Projeler basında ne sıklıkla, nasıl haberlerde yer almaktadır? Yerel medya bunların kaçına yer vermektedir? Seferihisar Belediyesi projeler ile basında sosyal belediyecilik faaliyetleri ve kültür etkinlikleri ile sık sık yer alındığı belirtilmiştir. Özellikle Mavi Bayrak Projesi (Citta Slow) ile dünya basınında da yer aldığı vurgulanmıştır.

Sosyal medya sitelerinde kaç takipçiniz var? Ne sıklıkla, nasıl içerikler yayınlıyorsunuz? Belediyenin Facebook'ta 18 bin, Instagram'da 5 bin, Twitter'da 6 bin takipçisinin olduğu söylenmiştir. Belediyenin sosyal medya sayfalarından bayram ve özel günlerde paylaşım yapıldığı, projeler ve festivaller ile ilgili paylaşımlarda bulunulduğu ve belediye çalışmalarının aktarıldığı söylenmiştir.

Devam eden proje/projeler var mı? Bu projeler yeterli mi, sayısı artmalı mı? Devam eden projeler olarak Mutlu Yuva Seferberliği, Doğa Mirası Projesi, Çocuk Belediyesi, Tohum Seferberliği, Kadın Emeği Evleri, Evladın İçin Bir Ağaç Dik isimleri verilmiştir. Bu projeler başarılı olsa da sayılarının artırılması gerektiği düşünülmektedir.

Belediyelerin kısa veya uzun dönemli projeleri var mı? Belediyenin en kısa ve en uzun süren projesi hangisidir? En uzun Mavi Bayrak (Citta Slow), en kısa Gün Aydın Olsun projelerinin sürdüğü söylenmiştir.

Belediyenin proje ekibi var mı, unvanları ve faaliyetleri yeterli mi? Halkla ilişkiler biriminde 7 kişi çalıştığı, her projenin proje uygulayıcı ekibi ve sorumlularının yeterli olduğu söylenmiştir.

Proje uygulamalarında hangi aşamaları takip ediyorsunuz? Projeler uygulanırken araştırma, geliştirme, uygulama, değerlendirme aşamalarının takip edildiği söylenmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Halkla ilişkiler projelerinin, belediyenin bilinirliğine etkisi var mı? Halkla ilişkiler projelerinin belediyenin bilinirliğine etkisi olduğu düşünülmektedir.

Projelerde başarıyı nasıl ölçüyorsunuz? Projelerde başarının projelere karşı talebin olması ve bu talebin karşılanabiliyor olması ile ölçümlendiği söylenmiştir.

Projelerin doğmasına hangi koşullar neden olmuştur, projelerin ortaya çıkış amacı halkın ihtiyaçlarını karşılıyor mu? Projelerin halkın maddi ve manevi ihtiyaçlarına karşılık vermek amacıyla gerçekleştirildiği söylenmiştir.

Halk düzenlenen projelere karşı ilgili mi? Halk projelere neden katılım sağlamak istemektedir? Halkın ilgili olduğu, projelerin maddi ve manevi faydası nedeniyle desteklendiği belirtilmiştir.

Projelerin halkın üzerinde yarattığı etkilerden memnun musunuz? Memnun olduğu belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken yaşanan genel sıkıntılar dikkate alınıyor mu? Herhangi bir sıkıntıda çözüme odaklanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeyle ilgili yaşadığınız herhangi bir kriz veya yaşanan büyük bir sorun var mıdır? Halkın projeler gerçekleştirilirken herhangi bir sıkıntı ile karşılaştığında belediye ile çözüm sürecine gittiği söylenmiştir.

Belediyenizde sorunlar nasıl yönetiliyor? Hemşehri İletişim Merkezi (HİM) ve Whatsapp aracılığı ile halkın şikayetleri belediyeye ulaşmaktadır. Şikayet hangi birim ile alakalı ise o birime yönlendirilmektedir.

Projelerde bütçe ile ilgili sıkıntılar yaşanıyor mu? Maddi sıkıntılar devam etmesine rağmen projelerin devam ettiği belirtilmiştir.

Projelere ilişkin pozitif/negatif geri dönüşler alınıyor mu? Seferihisar Belediyesi projelere ilişkin olumlu ve olumsuz geri dönüşler almaktadır. Bu geri dönüşleri dikkate alarak projeleri geliştirmek için fırsata dönüştürmektedir.

Belediyenin yürütmekte olduğu projeler hakkında nasıl bilgilendirme yapıyorsunuz? Web sitesi ve sosyal ağların kullanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeniz ne çeşit projelere ağırlık vermektedir? Toplumsal dayanışma, kültür-sanat ve sosyal sorumluluk projelerine ağırlık verildiği belirtilmiştir.

Projelerin süresi ne kadar? Her proje için sürenin değiştiği, belediyenin bu konuda esnek davrandığı memnuniyet durumuna göre sürenin uzatılabildiği belirtilmiştir.

Aynı anda birden fazla halkla ilişkiler projesi sürdürülüyor mu? Sürdürüldüğü belirtilmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Projeler yürütülürken değişiklik yapıyor mu? Projeler yürütülmeye başlamadan önce hazırlanan planın zaman zaman değişiklik gösterdiği söylenmiştir.

Projelerden en çok kimler yararlanıyor? Yerel halk, öğrenciler, engelliler gibi her projenin hedef kitlesinin farklı olabildiği belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken ortaya çıkan sorunlardan kimler etkileniyor? Projenin hedef kitlesi, belediye çalışanları ve yerel halk etkilenebileceği söylenmiştir.

Projelerin gerçekleştirilmesine karşı çıkan bir kesim var mı? Genellikle halkın projelere destek olduğu ve karşı çıkmadığı belirtilmiştir.

Projeler hakkında farkındalık yaratmak için herhangi bir çalışma yapılıyor mu? Bu tür çalışmaların sosyal medya üzerinden yapıldığı, afişler, billboardlar ve duyurular ile de desteklendiği söylenmiştir.

Projenin sonuçları hakkında hedef kitle, paydaşlar ve kamuoyu bilgilendiriliyor mu? Belediyeye gelenlerle yüz yüze, diğer kitlelere sosyal medya üzerinden bilgilendirme yapıldığı belirtilmiştir.

Projelerin tanınmasını ve hatırlanmasını sağlamak için çalışmalar yapılıyor mu? Proje tarihleri yaklaştığında afişler, duyurular ve sosyal medya üzerinden çalışmalar yapıldığı belirtilmiştir.

Belediyenin internet sitesinden projeler hakkında detaylı bilgiler yer alıyor mu? Detaylı bilgilere ulaşılabileceği belirtilmiştir.

Projelere yenileri eklendiği zaman web sitesinde güncelleme yapılıyor mu? Her yeni proje ile birlikte internet sitesinin projeler kısmının güncellendiği vurgulanmıştır.

Web sitesinde biten projelere yer veriliyor mu? Hem devam eden hem de tamamlanan projelerin web sitesinde yer aldığı söylenmiştir.

Diğer söylenmek istenenler nelerdir? Çalışmaya katıldıklarından dolayı mutlu oldukları aktarılmıştır.

Bornova Belediyesi:

Belediyenin halkla ilişkiler projeleri var mı? Aklınıza gelen halkla ilişkiler projeleri nelerdir? Bornova Belediyesinin birçok projesinden bahsedilmiş, akla ilk gelenin Dost Market Projesi olduğu açıklanmıştır.

Projeler basında ne sıklıkla, nasıl haberlerde yer almaktadır? Yerel medya bunların kaçına yer vermektedir? Bornova Belediyesinin projeler ile basında sık sık yer aldığı belirtilmiştir.

Sosyal medya sitelerinde kaç takipçiniz var? Ne sıklıkla, nasıl içerikler yayınlıyorsunuz? Belediyenin Facebook'ta 62 bin, Instagram'da 24 bin, Twitter'da 32 bin takipçisinin olduğu

söylenmiştir. Belediyenin sosyal medya sayfalarından bayram ve özel günlerde paylaşım yapıldığı, ilçeye ait görsellerle ilgili paylaşımlarda bulunulduğu, belediye çalışmalarının aktarıldığı söylenmiştir.

Devam eden proje/projeler var mı? Bu projeler yeterli mi, sayısı artmalı mı? Devam eden projeler olarak Çocuk Köyü Projesi, Çocuk Dünyası, Evimize Hoş Geldin Bebek, Sokak Kütüphanesi, Engelsiz Yaşam Merkezi ve Kedi Evleri isimleri verilmiştir. Bu projeler başarılı olsa da sayılarının artırılması gerektiği düşünülmektedir.

Belediyelerin kısa veya uzun dönemli projeleri var mı? Belediyenin en kısa ve en uzun süren projesi hangisidir? En uzun Dost Market, en kısa Toplu Nikah projelerinin sürdüğü söylenmiştir.

Belediyenin proje ekibi var mı, unvanları ve faaliyetleri yeterli mi? Halkla ilişkiler biriminde 31 kişi çalıştığı, her projenin proje uygulayıcı ekibi ve sorumlularının yeterli olduğu söylenmiştir.

Proje uygulamalarında hangi aşamaları takip ediyorsunuz? Projelerin uygulama aşamalarının tam olarak bilinmediği söylenmiştir.

Halkla ilişkiler projelerinin, belediyenin bilinirliğine etkisi var mı? Halkla ilişkiler projelerinin belediyenin bilinirliğine etkisi olduğu düşünülmektedir.

Projelerde başarıyı nasıl ölçüyorsunuz? Projelerde başarının uygulanan projenin başka kuruluşlar tarafından örnek alınıp uygulanması ölçümlendiği söylenmiştir.

Projelerin doğmasına hangi koşullar neden olmuştur, projelerin ortaya çıkış amacı halkın ihtiyaçlarını karşılıyor mu? Projelerin halkın maddi ve manevi ihtiyaçlarına karşılık vermek amacıyla gerçekleştirildiği söylenmiş, Bornova Belediyesinde projelerin ortaya çıkış amacının çoğunlukla halkın gereksinimleri olduğu belirtilmiştir.

Halk düzenlenen projelere karşı ilgili mi? Halk projelere neden katılım sağlamak istemektedir? Halkın ilgili olduğu, projelerin maddi ve manevi faydası nedeniyle desteklendiği belirtilmiştir.

Projelerin halkın üzerinde yarattığı etkilerden memnun musunuz? Memnun olduğun belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken yaşanan genel sıkıntılar dikkate alınıyor mu? Herhangi bir sıkıntıda çözüme odaklanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeyle ilgili yaşadığınız herhangi bir kriz veya yaşanan büyük bir sorun var mıdır? Halkın projeler gerçekleştirilirken herhangi bir sıkıntı ile karşılaştığında belediye ile çözüm sürecine gittiği söylenmiştir.

Belediyenizde sorunlar nasıl yönetiliyor? Hemşehri İletişim Merkezi (HİM) ve Whatsapp aracılığı ile halkın şikâyetleri belediyeye ulaşmaktadır. Şikâyet hangi birim ile alakalı ise o birime yönlendirilmektedir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Projelerde bütçe ile ilgili sıkıntılar yaşıyor mu? Maddi sıkıntılar devam etmesine rağmen projelerin devam ettiği belirtilmiştir. Ayrıca projeler gerçekleştirilirken maliyetin %25 i bağışçılar tarafından karşılandığı vurgulanmıştır.

Projelere ilişkin pozitif/negatif geri dönüşler alınıyor mu? Bornova Belediyesi projelere ilişkin olumlu ve olumsuz geri dönüşler almaktadır. Bu geri dönüşleri dikkate alarak projeleri geliştirmek için fırsata dönüştürmektedir.

Belediyenin yürütmekte olduğu projeler hakkında nasıl bilgilendirme yapıyorsunuz? Web sitesi ve sosyal ağların kullanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeniz ne çeşit projelere ağırlık vermektedir? Toplumsal dayanışma, kültür-sanat ve sosyal sorumluluk projelerine ağırlık verildiği belirtilmiştir.

Projelerin süresi ne kadar? Her proje için sürenin değiştiği, belediyenin bu konuda esnek davrandığı memnuniyet durumuna göre sürenin uzatılabildiği belirtilmiştir.

Aynı anda birden fazla halkla ilişkiler projesi sürdürülüyor mu? Sürdürüldüğü belirtilmiştir.

Projeler yürütülürken değişiklik yapılıyor mu? Projeler yürütülmeye başlamadan önce hazırlanan planın zaman zaman değişiklik gösterdiği söylenmiştir.

Projelerden en çok kimler yararlanıyor? Yerel halk, öğrenciler, engelliler gibi her projenin hedef kitlesinin farklı olabildiği belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken ortaya çıkan sorunlardan kimler etkileniyor? Projenin hedef kitlesinin etkilenebileceği söylenmiştir.

Projelerin gerçekleştirilmesine karşı çıkan bir kesim var mı? Genellikle halkın projelere destek olduğu ve karşı çıkmadığı belirtilmiştir.

Projeler hakkında farkındalık yaratmak için herhangi bir çalışma yapılıyor mu? Bu tür çalışmaların sosyal medya üzerinden yapıldığı, afişler, billboardlar ve duyurular ile de desteklendiği söylenmiştir.

Projenin sonuçları hakkında hedef kitle, paydaşlar ve kamuoyu bilgilendiriliyor mu? Belediyeye gelenlerle yüz yüze, diğer kitlelere sosyal medya üzerinden bilgilendirme yapıldığı belirtilmiştir.

Projelerin tanınmasını ve hatırlanmasını sağlamak için çalışmalar yapılıyor mu? Proje tarihleri yaklaştığında afişler, duyurular ve sosyal medya üzerinden çalışmalar yapıldığı belirtilmiştir.

Belediyenizin internet sitesinden projeler hakkında detaylı bilgiler yer alıyor mu? Detaylı bilgilere ulaşılabileceği belirtilmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Projelere yenileri eklendiği zaman web sitesinde güncelleme yapılıyor mu? Her yeni proje ile birlikte internet sitesinin projeler kısmının güncellendiği vurgulanmıştır.

Web sitesinde biten projelere yer veriliyor mu? Web sitesinde biten projelerin yer almadığı söylenmiştir.

Diğer söylenmek istenenler nelerdir? Çalışmaya katıldıkları için mutlu oldukları belirtilmiştir.

Menderes Belediyesi:

Belediyenin halkla ilişkiler projeleri var mı? Aklınıza gelen halkla ilişkiler projeleri nelerdir? Menderes Belediyesinin birçok projesinden bahsedilmiş, akla ilk gelenlerin Hayat Boyu Öğrenme ve Tek Tuşla Menderes olduğu açıklanmıştır.

Projeler basında ne sıklıkla, nasıl haberlerde yer almaktadır? Yerel medya bunların kaçına yer vermektedir? Menderes Belediyesinin projeler ile basında sık sık yer aldığı belirtilmiştir.

Sosyal medya sitelerinde kaç takipçiniz var? Ne sıklıkla, nasıl içerikler yayınlıyorsunuz? Belediyenin Facebook'ta 8 bin, Instagram'da bin, Twitter'da 9 bin takipçisinin olduğu söylenmiştir. Belediyenin sosyal medya sayfalarından bayram ve özel günlerde paylaşım yapıldığı, ilçeye ait görsellerle ilgili paylaşımlarda bulunduğu, belediye çalışmalarının aktarıldığı söylenmiştir.

Devam eden proje/projeler var mı? Bu projeler yeterli mi, sayısı artmalı mı? Devam eden projeler olarak Ambalaj Atığı Toplama, Hayat Boyu Öğrenme ve Tek Tuşla Menderes isimleri verilmiştir. Bu projeler başarılı olsa da sayılarının artırılması gerektiği düşünülmektedir.

Belediyelerin kısa veya uzun dönemli projeleri var mı? Belediyenin en kısa ve en uzun süren projesi hangisidir? En uzun Tek Tuşla Menderes, en kısa Trafo Boyama projelerinin sürdüğü söylenmiştir.

Belediyenin proje ekibi var mı, unvanları ve faaliyetleri yeterli mi? Halkla ilişkiler biriminde 7 kişi çalıştığı, her projenin proje uygulayıcı ekibi ve sorumlularının yeterli olduğu söylenmiştir.

Proje uygulamalarında hangi aşamaları takip ediyorsunuz? Projelerin uygulama aşamalarının hazırlık, değerlendirme, sözleşme, proje ekibi oluşturma, satın alma, bütçeleme, sisteme giriş, raporlama ve görüngeler olduğu söylenmiştir.

Halkla ilişkiler projelerinin, belediyenin bilinirliğine etkisi var mı? Halkla ilişkiler projelerinin belediyenin bilinirliğine etkisi olduğu düşünülmektedir.

Projelerde başarıyı nasıl ölçüyorsunuz? Projelerde başarının projelere karşı talebin ve bu talebin karşılanabiliyor olması ile ölçümlendiği söylenmiştir

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Projelerin doğmasına hangi koşullar neden olmuştur, projelerin ortaya çıkış amacı halkın ihtiyaçlarını karşılıyor mu? Projelerin halkın maddi ve manevi ihtiyaçlarına karşılık vermek amacıyla gerçekleştirildiği söylenmiş, Menderes Belediyesinde projelerin ortaya çıkış amacının çoğunlukla halkın gereksinimleri olduğu belirtilmiştir.

Halk düzenlenen projelere karşı ilgili mi? Halk projelere neden katılım sağlamak istemektedir? Halkın ilgili olduğu, projelerin maddi ve manevi faydası nedeniyle desteklendiği belirtilmiştir.

Projelerin halkın üzerinde yarattığı etkilerden memnun musunuz? Memnun olduğu belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken yaşanan genel sıkıntılar dikkate alınıyor mu? Herhangi bir sıkıntıda çözüme odaklanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeyle ilgili yaşadığınız herhangi bir kriz veya yaşanan büyük bir sorun var mıdır? Halkın projeler gerçekleştirilirken herhangi bir sıkıntı ile karşılaştığında nasıl bir çözüm sürecine gittiği belirtilmemiştir.

Belediyenizde sorunlar nasıl yönetiliyor? Şikayet Yönetim Sistemi aracılığı ile halkın şikayetleri belediyeye ulaşmaktadır. Şikayet hangi birim ile alakalı ise o birime yönlendirilmektedir.

Projelerde bütçe ile ilgili sıkıntılar yaşanıyor mu? Maddi sıkıntılar devam etmesine rağmen projelerin devam ettiği belirtilmiştir.

Projelere ilişkin pozitif/negatif geri dönüşler alınıyor mu? Menderes Belediyesi projelere ilişkin olumlu ve olumsuz geri dönüşler almaktadır.

Belediyenin yürütmekte olduğu projeler hakkında nasıl bilgilendirme yapıyorsunuz? Web sitesi ve sosyal ağların kullanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeniz ne çeşit projelere ağırlık vermektedir? Toplumsal dayanışma projelerine ağırlık verildiği belirtilmiştir.

Projelerin süresi ne kadar? Her proje için sürenin proje başlamadan önce belirlendiği belirtilmiştir.

Aynı anda birden fazla halkla ilişkiler projesi sürdürülüyor mu? Sürdürüldüğü belirtilmiştir.

Projeler yürütülürken değişiklik yapılıyor mu? Projeler yürütülmeye başlamadan önce hazırlanan planın zaman zaman değişiklik gösterdiği söylenmiştir.

Projelerden en çok kimler yararlanıyor? Projelerden yerel halkın yararlandığı söylenmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken ortaya çıkan sorunlardan kimler etkileniyor? Projeler gerçekleştirilirken yerel halkın etkilendiği söylenmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Projelerin gerçekleştirilmesine karşı çıkan bir kesim var mı? Genellikle halkın projelere destek olduğu ve karşı çıkmadığı belirtilmiştir.

Projeler hakkında farkındalık yaratmak için herhangi bir çalışma yapılıyor mu? Bu tür çalışmaların sosyal medya üzerinden yapıldığı, afişler, billboardlar ve duyurular ile de desteklendiği söylenmiştir.

Projenin sonuçları hakkında hedef kitle, paydaşlar ve kamuoyu bilgilendiriliyor mu? Belediye gelenlerle yüz yüze, diğer kitlelere sosyal medya üzerinden bilgilendirme yapıldığı belirtilmiştir.

Projelerin tanınmasını ve hatırlanmasını sağlamak için çalışmalar yapılıyor mu? Proje tarihleri yaklaştığında afişler, duyurular ve sosyal medya üzerinden çalışmalar yapıldığı belirtilmiştir.

Belediyenin internet sitesinden projeler hakkında detaylı bilgiler yer alıyor mu? Detaylı bilgilere ulaşılabileceği belirtilmiştir.

Projelere yenileri eklendiği zaman web sitesinde güncelleme yapılıyor mu? Her yeni proje ile birlikte internet sitesinin projeler kısmının güncellendiği vurgulanmıştır.

Web sitesinde biten projelere yer veriliyor mu? Web sitesinde biten projelere yer verildiği söylenmiştir.

Diğer söylenmek istenenler nelerdir? Çalışmaya katıldıkları için mutlu oldukları belirtilmiştir.

Bayındır Belediyesi:

Belediyenin halkla ilişkiler projeleri var mı? Aklınıza gelen halkla ilişkiler projeleri nelerdir? Bayındır Belediyesinin birçok projesinden bahsedilmiş, akla ilk gelenin Çiçek Festivali olduğu açıklanmıştır.

Projeler basında ne sıklıkla, nasıl haberlerde yer almaktadır? Yerel medya bunların kaçına yer vermektedir? Bayındır Çiçek Festivali projesi ile basında sık sık yer alındığı belirtilmiştir.

Sosyal medya sitelerinde kaç takipçiniz var? Ne sıklıkla, nasıl içerikler yayınlıyorsunuz? Belediyenin Facebook'ta 8 bin, Instagram'da 2 bin, Twitter'da bin takipçisinin olduğu söylenmiştir. Belediyenin sosyal medya sayfalarından bayram ve özel günlerde paylaşım yapıldığı, vefat eden sanatçılar, yazarlar, politikacılar için paylaşımlarda bulunduğu, belediye çalışmalarının aktarıldığı söylenmiştir. Ayrıca esnaf buluşmaları, düğün, nişan, sünnet törenleri gibi paylaşımlara da yer verildiği belirtilmiştir.

Devam eden proje/projeler var mı? Bu projeler yeterli mi, sayısı artmalı mı? Devam eden projeler olarak Mutlu Bebek ve Çiçek Festivali isimleri verilmiştir. Bu projeler başarılı olsa da sayılarının artırılması gerektiği düşünülmektedir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Belediyelerin kısa veya uzun dönemli projeleri var mı? Belediyenin en kısa ve en uzun süren projesi hangisidir? En uzun süren projenin Çiçek Festivali olduğu söylenirken en kısa süren projenin hangisi olduğu söylenmemiştir.

Belediyenin proje ekibi var mı, unvanları ve faaliyetleri yeterli mi? Halkla ilişkiler biriminde 4 kişi çalıştığı, her projenin proje uygulayıcı ekibi ve sorumlularının yeterli olduğu söylenmiştir.

Proje uygulamalarında hangi aşamaları takip ediyorsunuz? Projeler uygulanırken araştırma, geliştirme, uygulama ve değerlendirme aşamalarının takip edildiği söylenmiştir.

Halkla ilişkiler projelerinin, belediyenin bilinirliğine etkisi var mı? Halkla ilişkiler projelerinin belediyenin bilinirliğine etkisi olduğu düşünülmektedir.

Projelerde başarıyı nasıl ölçüyorsunuz? Projelerde başarının vatandaş memnuniyeti ile ölçümlendiği söylenmiştir.

Projelerin doğmasına hangi koşullar neden olmuştur, projelerin ortaya çıkış amacı halkın ihtiyaçlarını karşılıyor mu? Projelerin halkın maddi ve manevi ihtiyaçlarına karşılık vermek amacıyla gerçekleştirildiği söylenmiş, Bayındır Belediyesinde projelerin ortaya çıkış amacının çoğunlukla halkın gereksinimleri olduğu belirtilmiştir.

Halk düzenlenen projelere karşı ilgili mi? Halk projelere neden katılım sağlamak istemektedir? Halkın ilgili olduğu, projelerin maddi ve manevi faydası nedeniyle desteklendiği belirtilmiştir.

Projelerin halkın üzerinde yarattığı etkilerden memnun musunuz? Memnun olduğu belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken yaşanan genel sıkıntılar dikkate alınıyor mu? Herhangi bir sıkıntıda çözüme odaklanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeyle ilgili yaşadığınız herhangi bir kriz veya yaşanan büyük bir sorun var mıdır? Halkın projeler gerçekleştirilirken herhangi bir sıkıntı ile karşılaştığında belediye ile çözüm sürecine gittiği söylenmiştir.

Belediyenizde sorunlar nasıl yönetiliyor? Şikayet Yönetim Sistemi aracılığı ile halkın şikayetleri belediyeye ulaşmaktadır. Şikayet hangi birim ile alakalı ise o birime yönlendirilmektedir.

Projelerde bütçe ile ilgili sıkıntılar yaşanıyor mu? Maddi sıkıntılar devam etmesine rağmen projelerin devam ettiği belirtilmiştir.

Projelere ilişkin pozitif/negatif geri dönüşler alınıyor mu? Bayındır Belediyesi projelere ilişkin olumlu ve olumsuz geri dönüşler almaktadır. Bu geri dönüşleri dikkate alarak projeleri geliştirmek için fırsata dönüştürmektedir.

Belediyenin yürütmekte olduğu projeler hakkında nasıl bilgilendirme yapıyorsunuz? Web sitesi ve sosyal ağların kullanıldığı belirtilmiştir.

Belediyeniz ne çeşit projelere ağırlık vermektedir? Toplumsal dayanışma projelerine ağırlık verildiği belirtilmiştir.

Projelerin süresi ne kadar? Projeler başlamadan önce sürelerinin belirlendiği söylenmiştir.

Aynı anda birden fazla halkla ilişkiler projesi sürdürülüyor mu? Sürdürüldüğü belirtilmiştir.

Projeler yürütülürken değişiklik yapılıyor mu? Projeler yürütülmeye başlamadan önce hazırlanan planın zaman zaman değişiklik gösterdiği söylenmiştir.

Projelerden en çok kimler yararlanıyor? Yerel halk, öğrenciler, engelliler gibi her projenin hedef kitlesinin farklı olabildiği belirtilmiştir.

Projeler gerçekleştirilirken ortaya çıkan sorunlardan kimler etkileniyor? Projenin hedef kitlesinin etkilenebileceği söylenmiştir.

Projelerin gerçekleştirilmesine karşı çıkan bir kesim var mı? Genellikle halkın projelere destek olduğu ve karşı çıkmadığı belirtilmiştir.

Projeler hakkında farkındalık yaratmak için herhangi bir çalışma yapılıyor mu? Bu tür çalışmaların sosyal medya üzerinden yapıldığı, afişler, billboardlar ve duyurular ile de desteklendiği söylenmiştir.

Projenin sonuçları hakkında hedef kitle, paydaşlar ve kamuoyu bilgilendiriliyor mu? Belediyeye gelenlerle yüz yüze, diğer kitlelere sosyal medya üzerinden bilgilendirme yapıldığı belirtilmiştir.

Projelerin tanınmasını ve hatırlanmasını sağlamak için çalışmalar yapılıyor mu? Proje tarihleri yaklaştığında afişler, duyurular ve sosyal medya üzerinden çalışmalar yapıldığı belirtilmiştir.

Belediyenizin internet sitesinden projeler hakkında detaylı bilgiler yer alıyor mu? Detaylı bilgilere ulaşılabileceği belirtilmiştir.

Projelere yenileri eklendiği zaman web sitesinde güncelleme yapılıyor mu? Her yeni proje ile birlikte internet sitesinin projeler kısmının güncellendiği vurgulanmıştır.

Web sitesinde biten projelere yer veriliyor mu? Tamamlanan projelerin web sitesinde yer almadığı söylenmiştir.

Diğer söylenmek istenenler nelerdir? Çalışmaya katıldıkları için mutlu oldukları belirtilmiştir.

4.TARTIŞMA VE SONUÇ

Yapılan görüşmelerde belediyelerin yalnızca geleneksel mecraları değil aynı zamanda yeni medyayı kullandıkları görülmüştür. Bu durum farklı iletişim kanallarının kullanıldığı fikrini oluşturmaktadır. Dijital ortamlar halkla ilişkiler projelerinin sürdürülebilir olmasına katkı sağlamaktadır. Belediyeler, sosyal medya ağlarından Facebook, Twitter ve Instagram'ı kullanmaktadır. Belediyelerin sosyal medya sayfalarının takipçi açısından zengin olduğu görülmektedir. Karşıyaka Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü Nail Çetin görüşme sırasında şunları aktarmıştır:

“Halk bize en çok internet üzerinden ulaşıyor. Instagram, Twitter, Facebook da toplamda 65 bin takipçimiz var. Belediyenin düzenli olarak günlük paylaşımları yapıyor. Karşıyaka halkına her sabah “günaydın” diyoruz. Özel günlerde sosyal mesajlar veriyoruz. Belediyenin günlük çalışmalarını, etkinliklerini duyuruyoruz. Sosyal medyada projeler hakkında bilgiler ve duyurular paylaşılıyor. Böylece halk hem haberdar oluyor hem de projelere uzun süreli katılım sağlamış oluyor”.

Bornova Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü Hasan Çimen'in ise konuya ilişkin görüşleri aşağıda yer almaktadır:

“İki tane sosyal medya hesabımız var. Bir Bornova Belediyesi var bir de belediye başkanına ait olan var. Bu ağlarda belediyenin hizmetleri anlatılıyor. Başkanın mesajları iletiliyor. Vatandaşın bize dilek ve şikâyetleri ile ulaşmasını sağlıyoruz. Bu ağlardan halk projeler hakkında bilgilendiriliyor. 4-5 kişilik ekip sadece bu iş ile uğraşiyor”.

Belediyelerin basında halkla ilişkiler projeleri ile yer almaları kamunun ilçelere yönelik ilgisini arttırmaktadır. Bu ilçeler, basında yer alan haberler ile daha fazla ziyaretçinin, yatırımcının dikkatini çekmekte ve nitelikli göç alabilmektedir. Bu noktadan hareketle belediyelerin yapılan projeler ile yerel halkın maddi ve manevi olarak yanında olmaya çalıştıklarını ve onlara değer verdiklerini göstermektedir. Seferihisar Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü İnanç Karabulut görüşme sırasında şunları aktarmıştır:

“Halkla ilişkiler projeleri ile halka her anlamda yardımcı olmaya çalışıyoruz. Halkın gereksinimlerinden yola çıkarak başlattığımız her projeden olumlu geri dönüşler alıyoruz. İlçede yaşayan halk bu projelerden oldukça memnun çünkü gelir durumunda çok belirgin bir artış yaşandı. Ekmeğimiz büyüdü diyebiliriz. Bununla beraber halk çok ciddi bir zihin dönüşümü de yaşadı”.

Belediyelerin kendi içlerinde şikâyet yönetimine ilişkin izledikleri belli süreçler bulunmaktadır. Belediyelerde şikâyetlere ilişkin bir sistemin bulunması yerel halkın tepkilerinin dikkate alındığını göstermektedir. Ayrıca yapılan şikâyetler, belediyelerin yaptıkları çalışmalarını halkı merkeze alarak dönüştürmelerine ve geliştirmelerine neden olabilmektedir. Bornova Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü Hasan Çimen'in konuya ilişkin görüşleri aşağıda yer almaktadır:

“Yüz yüze şikâyetlerimiz oluyor. Yazı işlerinden giriş yapılıyor. Dilekçe dolduruyorlar. Takip numarası veriyoruz. En geç 15 gün içerisinde dönüş yapıyoruz. Facebook ve Twitter’den çok fazla mesaj alıyoruz. Müdürlüklere şikâyetleri iletene kadar ki sürede bile krizi ve sorunu iyi yönetiyoruz. Daha telefonla konuşurken bile anında giriş yapıp ilgili müdürlüğe şikâyeti iletiyoruz. Nöbetçi sistemimiz var gece bile çalışıyoruz”.

Belediyelerin halkla ilişkiler projelerini yürütürken yaşanan sorunların daha iyi çözülebilmesi için çıkabilecek krizlerin etkili bir şekilde yönetilmesi gerekmektedir. Seferihisar Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü İnanç Karabulut görüşme sırasında şunları aktarmıştır:

“Sokak hayvanları için “Mutlu Yuva Projesi” başlattık. Sokak hayvanlarının tedavisi, barınması gibi ihtiyaçlarını karşılamak adına emsal belediyelerden en az 10 katı fazla bir bütçe ayırdık. Bir bayram günü kadının biri eceli ile ölmüş bir köpeğin fotoğrafını çekip sosyal medyaya yükledi. Demet Akalın bu fotoğrafı retweet yaptı. Bütün bayram bize zehir oldu. Bu krizi yönetmek çok zor oldu. İlk kriz olduğu için başarısızdık. Hemen krize müdahale edemedik. “Mutlu Yuva Projesi” başarılı oldukça bu talihsiz olay da kapanıp gitti”.

Belediyelerde yapılan görüşmede halkla ilişkiler projelerinin artması gerektiği savunulmaktadır. Halkla ilişkiler projeleri halk ile yönetim arasındaki ilişkinin daha çok gelişmesine katkı sağlamaktadır.

Belediyelerin tamamının projelerin uygulama aşamalarını biliyor olması, projelerin başlama aşamasından tamamlanma aşamasına kadar geçen süreyi etkili ve başarılı bir şekilde yürütebileceklerini akla getirmektedir. Menderes Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü Gamze Gül Mungan ile yapılan görüşme sırasında alınan bilgiler aşağıdadır:

“Projeler belli başlı aşamalardan geçiyor. İlk aşama proje hazırlık aşaması. Daha sonra değerlendirmeye gönderiliyor. Değerlendirme sonucunda proje başarılı olursa projenin sözleşme süresi var. Sözleşme aşaması tamamlandığı zaman proje başlıyor. Ayrıca her projenin proje takip sistemi var. Oradan takibini yapmaya devam ediyoruz. Proje ekibi oluşturuluyor. Sonrasında yerler, yer için ekipmanlar, o ekipmanların satın alma kısmı, bütçeleme, muhasebe, değerlendirme ve raporlama var. Raporlama ve proje başlangıcı arasında da görünürlük diye hitap edilen projenin göstergeleri var. Billboardlar, afişler, duyurular gibi...”

Belediyeler, başarıyı ölçümlerken halkın dilek ve şikâyetleri hakkında bilgi almak için geri dönüşüm ve memnuniyet anketleri yapmaktadır. Bu anketler sayesinde hem projeye katılımın ne kadar olduğunu hem de katılımların sebebinin ne olduğunu görebilmektedir. Bornova Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü Hasan Çimen’in konuya ilişkin görüşleri aşağıda yer almaktadır:

“Her ay bir gazete çıkarıyoruz. 3 ayda 1 kültür ve sanat dergisi çıkarıyoruz. Her gün iki tane haber servisimiz oluyor ve video haline getiriyoruz. Her gün halk ziyaretleri yapıyor, ayrıca vatandaşla

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

iletişime WhatsApp yolu ile de geçiyoruz. Vatandaşı bilgilendiriyoruz. Düzenli olarak memnuniyet anketleri yapıyoruz. Bu anketlerin sonuçları ile halkla ilişkiler departmanımızda çalışan arkadaşlar ilgileniyor. Projeye katılımın ne kadar olduğunu, neden katıldıklarını anketler sonucunda öğrenebiliyoruz. Çok yönlü bir iletişim ağıımız var. Vatandaşla iletişim halinde olan bir belediyeyiz”.

Belediyelerin, yerel halkın projelere olan katılımından memnun olması, projelerin halkın ihtiyaçlarına ve beklentilerine cevap verdiği anlamına gelebilmektedir. Tek Tuşla Menderes Kampanyası hakkında Menderes Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü Gamze Gül Mungan'ın açıklamaları aşağıda yer almaktadır:

“Belediyeye gelerek halledilen işleri kolaylaştırmak adına gerçekleştirilen bir projedir. Kırsal bir bölgedeyiz. Kışın otobüs saatleri seyrek oluyor. Gümüldür'den işini halletmek için belediyeye gelmek hak için çok büyük bir sıkıntı haline gelmişti. Şikayetler alıyorduk. Bir saat yol çekerek belediyeye ulaşan bir kesim var. Onları da düşünerek Tek Tuşla Menderes Projesini gerçekleştirdik”.

Belediyeler projeler ile ilgili olumsuz geri dönüş aldıkları zaman bu durumu projeleri geliştirmek ve iyileştirmek için bir fırsat olarak görmektedir. Olumlu alınan görüşleri ise başarıyı destekleyen bir yöntem olarak düşündüklerini belirtmişlerdir. Buca Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü Arzu Turan görüşme sırasında şunları aktarmıştır:

“Projelerden çok güzel geri dönüşler alıyoruz. Örneğin Tarık akan projesinde merkezi kullanan gençlerin ailelerinden teşekkür mektupları aldık. Bir tanesi çocuğunun bu merkezde zaman geçirmeye başladığından beri sigara kullanmayı bıraktığını söyledi. Olumsuz olarak hiç eleştiri almadık sadece civardaki çamaşırhaneler ücretsiz çamaşır yıkama hizmeti vermemize tepki gösterdi”.

Halkın projelere yönelik olumlu ve olumsuz düşüncelerinin belediyeler tarafından biliniyor olması, yerel halk düşüncelerinin takip edildiğini göstermektedir. Yönetime karşı olumlu tutum içine giren halk belediyeye karşı daha fazla bağlılık ve sempati duyduğunu söylemektedir. Bayındır Belediyesi Basın Yayın ve Halkla İlişkiler Müdürü Dilek İri'nin görüşme sırasında aktardıkları aşağıda yer almaktadır.

“Geçim kaynağı çiçekçilik olan halk Çiçek Festivali'nin düzenli olarak yapılıyor olmasından çok memnun. Her yıl belirli tarihlerde gerçekleştirilen bu festival Bayındır'a hem maddi hem manevi fayda sağlıyor. Bu yüzden belediye ile ilgili olumlu düşüncelerini her zaman dile getiriyorlar”.

Belediyeler görüşme sırasında bütçe ile ilgili sıkıntı yaşadıklarını söylemekte ve görüşme yapılan belediyelerin tamamının projelere karşı yaşadıkları temel sıkıntının mali kaygılar olduğu görülmektedir.

Belediyelerin kısa veya uzun dönemli projeleri bulunmaktadır. Bu projelerde çalışan ekibin unvanlarının ve faaliyetlerinin yeterli görülmesi proje yönetimini başarılı yürütebileceklerini göstermektedir. Yerel halkın projelere katılım sağladığının görülmesi halkın projelere kendilerine maddi

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

ve manevi fayda sağladığını düşündükleri için ilgi gösterdiğini yansıtmaktadır. Genellikle belediyeler toplumsal dayanışma, kültür-sanat ve sosyal sorumluluk projelerine yer vermektedir. Bu projelerin süreleri değişiklik göstermektedir. Ayrıca belediyenin yürütmekte olduğu projeler hakkında sosyal medyadan, internet sitesinden ve ilçede asılan afişler aracılığıyla bilgilendirme yapılmaktadır.

Aynı anda birden fazla halkla ilişkiler projesinin sürdürülüyor olması çoklu proje yönetim yeteneklerine sahip olduklarını göstermektedir.

Web sitesinde projelerin başlangıcından bitişine kadar detaylı olarak her bilgi yer almaktadır. Projeler yürütülürken değişiklik yapıyor olması proje yönetiminde esneklik olduğunu göstermektedir.

Projelerden her proje için ayrı hedeflenen hedef kitlenin yararlanıyor olması projeler gerçekleştirilirken de ortaya çıkan sorunlardan bu hedef kitlenin etkileniyor olduğu söylenmektedir. Bu nedenle projenin sonuçları hakkında hedef kitle, paydaşlar ve kamuoyu bilgilendirilmektedir. Belediyenin internet siteleri üzerinden projeler hakkında detaylı bilgiler verilmektedir. Bu bilgilendirmenin yapıyor olması halk ile açık, şeffaf ve sağlıklı iletişim kurulabiliyor olduğunu da yansıtmaktadır.

Projeler belediyenin internet sitesinde tamamlanan, planlanan ve sürdürülen projeler olarak yer almaktadır. Projelere yenileri eklendiği zaman web sitesinde güncellemeler yapılmaktadır.

Projenin tanınmasını ve hatırlanmasını sağlamak için çoğunlukla sosyal medya üzerinden çalışmalar yapıyor olması halkın sosyal medyada aktif olarak yer aldığını göstermektedir.

KAYNAKÇA

Akkoyunlu G. Ş. ve Kalyoncuoğlu S. (2014) "İşletmelerin Kurumsal Sosyal Sorumluluk Çalışmalarının Marka Algısı Üzerine Etkisinin Değerlendirilmesi", Niğde Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 7(3): 125-144.

Ekinci, A ve Karakuş, M. (2011) "İlköğretim Okullarında Müfettişlerce Yapılan Rehberlik ve Denetim Çalışmalarının İşlevselliği", Kuram ve Uygulamada Eğitim Bilimleri Dergisi,11(4): 1849-1867.

Kazancı, M. (1997) " Kamu ve Özel Sektörde Halkla İlişkiler", Ankara: Turhan Kitapevi.

Mıhçıoğlu, C. (1992) "Kamu Yönetiminde ve Belediyelerde Halkla İlişkiler", Marmara İletişim Dergisi, 1:186.

Özer, A. (2013) "Yerel Yönetimlerin Varlık Nedeni Olarak 'Halkla' İlişkileri", Kafkas Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 4 (5): 19-50.

Sezer, B. U. (1996) " Yerel Yönetimler ve Halkla İlişkiler", Çağdaş Yerel Yönetimler Dergisi, 5(6): 66-70.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Sumak, M., E. (2001) Kamu ve Özel Sektörde Halkla İlişkiler Karşılaştırmalı Bir Analiz, Selçuk Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Kamu Yönetimi Anabilim Dalı, Siyaset ve Sosyal Bilimler Bilim Dalı Yayınlanmamış Yüksek Lisans Tezi, Konya.

Yalçındağ, S. (1985) “Kamu Yönetiminde Halkla İlişkiler”, Amme İdaresi Dergisi, 19 (1):131-156.

Yalçındağ, S. (1996) “Belediyelerimiz ve Halkla İlişkileri”, Ankara: TODAİE Yayını.

Yeygel, S. ve Yakın, M. (2007) “Kurumsal Reklamlarda Göstergeler Aracılığıyla Marka Kimliğinin İletilmesi”, Selçuk İletişim Dergisi, 5(1): 102-117.



YENİ MEDYA RAHATSIZLIKLARI: YENİ NESİL MEDYAYA FARKLI BİR BAKIŞ

Mikail Batu*

Handan Güler-İplikçi**

ÖZET

Günümüzde gelişen teknolojilerle beraber, veri depolama araçlarının (hard disklerin) kapasitesinin geçmişteki bilgi teknolojilerine göre çok yüksek olduğu, bilgi elde etme teknolojilerinin teknik ücretlerinin gün geçtikçe azaldığı ve bunlara paralel internet olanaklarının arttığı görülmektedir. İnternet olanaklarının artması ile beraber yeni medyada yer alan uygulamaların da arttığı ve farklı yaşta kişiler için daha çekici hale geldiği görülmektedir. Ancak günümüzde birçok akademik çalışmada bahsedildiği gibi bilgi iletişim teknolojileri ve yeni medya, modern insanın hayatını kolaylaştırmakla beraber birçok negatif etkiye de sahip olabilmektedir. Sosyal, psikolojik veya bedensel rahatsızlıklar buna örnek verilebilir. 21. yüzyıla beraber tanımlanmaya başlanan yeni medya rahatsızlıkları günlük hayatı ve insan ilişkilerini doğrudan etkileyebilmektedir.

Bu çalışmada literatür incelemesi yapılarak yeni medyanın insanlar üzerinde yarattığı rahatsızlıklar ele alınmaktadır. Detaylı bir şekilde literatür incelenerek yeni medyanın bilinçsiz veya aşırı kullanımının fare-klavye hastalığı, Ego Sörfü, Google Takibi, Siberhondrik, Photolurking, Crackberry, Cheesepodding, Blog İfşacılığı, Nomofobi, Hikikomori, FOMO, Youtube Narsisizmi, Myspace Taklitçiliği, Wikipedializm gibi kavramlarla tanımlanan birçok negatif etkisi bulunabilmektedir. Çalışmada bu rahatsızlıklar irdelenmekte ve bazı önerilerde bulunmaktadır.

Anahtar Kelimeler: Yeni Medya, Yeni Medya Rahatsızlıkları, Sosyal Medya.

JEL Kodları: D83, I12, L82.

NEW MEDIA DISORDERS: A DIFFERENT APPROACH TO NEW GENERATION MEDIA

ABSTRACT

With the developing technologies, it is seen that the capacity of data storage devices (hard disks) is higher compared to the information technologies in the past, the technical fees of the information acquisition technologies gradually decrease, and the internet facilities increase parallel to these developments. With the increase of internet facilities, it is also seen that the applications in the new media have increased and become more attractive for people of different ages. However, as stated in

* Doçent Doktor, Ege Üniversitesi İletişim Fakültesi Halkla İlişkiler ve Tanıtım Bölümü, mikail.batu@ege.edu.tr

** Araştırma Görevlisi Dr., Celal Bayar Üniversitesi Uygulamalı Bilimler Yüksek Okulu, Bankacılık ve Finans Bölümü, handan.guler@cbu.edu.tr

many academic studies today, information communication technologies and new media can have several negative effects while they make the lives of modern people easier and more comfortable. Social, psychological or physical disorders, which occur with the widespread use of new media, are examples of these negative effects. New media disorders, which start to be defined in 21st century, can directly affect the daily life and human relations.

In the study, the effects of new media disorders on people are handled by examining a literature review. Unconscious or overuse of new media can cause several disorders defined by terms such as mouse-keyboard disease, Ego Surfing, Google Tracking, Cyberhondriac, Photolurking, Crackberry, Cheesepodding, Blog Exposure, Nomophobia, Hikikomori, FOMO, Youtube Narcissism, Myspace Counterfeiting, Wikipedialism. In this study, these disorders are analyzed and some suggestions are made about these issues.

Keywords: *New Media, New Media Disorders, Social Media.*

JEL Codes: *D83, I12, L82.*

1.GİRİŞ

Dünya üzerinde her yaştan pek çok insan yeni medyayı yoğun olarak kullanmaktadır. Yeni medyanın kontrolsüz olarak kullanımı ise bedensel ve ruhsal olarak pek çok hastalığa zemin hazırlamaktadır. İş hayatından ve günlük hayattan kesitler, çeşitli hikayeler, beğeniler, retweetlerin sürekli akışı gibi bir çok örnekle hayatımızın merkezinde yer alan sosyal medyanın kullanıcılarda oluşturduğu rahatsızlıklar ise azımsanmayacak derecede yaygındır.

İnsanların sevilme, beğenilme ve takdir edilme ihtiyacı doğuştan gelen bir gereksinimdir. Sosyalleşmenin takipçi sayısı ile eşdeğer tutulduğu dijital çağ' da ise diğer insanların kendileri hakkında olan izlenimleri bazı bireyler için takıntı haline gelmiştir. Bu takıntının temelinde, geçmiş yıllarda yaşanan toplumsal baskının halk söyleminde karşılığı olan "el-alem ne der?", "başkaları ne düşünür?" gibi sorunsallar yer almaktadır. Kişilerin asosyal görünme, arkadaş grubundan dışlanma, gündemi kaçırma ya da çağın gerisinde kalma korkusu, sosyal medyanın kontrolsüz ve hastalıklı bir biçimde kullanımını tetikleyen etkenler olarak görülebilir.

Sosyal medya üzerinden paylaşılan herhangi bir ileti hakkettiği ilgiyi görmediğinde bireyin stresli ve hayal kırıklığına uğramış hissetmesi normal karşılanırken, bu stresi yaşamamak için paylaşımlarını belirli zaman aralığında (Örn: prime time) yapması ve daha çok kullanıcının görmesini sağlamaya çalışması takıntı belirtisi olarak kabul edilebilir. Sosyal medyanın gereğinden fazla kullanılması insanların gerçek hayattan kopmasına ve dış dünyaya karşı duyarsızlaşmasına neden olabilmektedir. Aynı şekilde aşırı dijital medya kullanımının teknoloji ve internet bağımlılığına neden olduğu da bilinen bir gerçektir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Sosyal medyayı ve teknolojiyi bir mutluluk anahtarı olarak kullanmak, yeni medya rahatsızlıklarına temel oluşturmaktadır. Dijital dünya algısı, gerçek dünya algısından oldukça farklıdır. İletişimin, anında ve karşılıklı gerçekleşmesi kullanıcının sürekli çevrimiçi(online) olması gerekliliğini doğurmaktadır. Dijital medyadaki (Facebook, Twitter, Instagram, WhatsApp vb.) akışın çok hızlı olması, yüzlerce iletinin aynı anda paylaşılması kullanıcılarda farklılaşma ve takip edilme ihtiyacını körüklemektedir. Dijital medya kullanıcıları farklılaşmak ve arkadaş/takipçi sayısını arttırabilmek adına benliklerini popüler kavramlar üzerinden yeniden inşa etmektedirler. Kullanıcılar fotoğrafları filtreleyerek ve bazı programlar yardımıyla değiştirerek istedikleri görüntüye kavuşabilmekte, bir kaç kitaptan alıntı yaparak kendilerini entellektüel olarak lanse edebilmektedir. Kısaca birey teknolojinin yardımıyla kendi algısındaki mükemmel insana kolayca dönüşebilmektedir. Bu durum bireyin gerçeklik algısının bozulmasına neden olmaktadır. Birey sanal alemde yarattığı “muhteşem” hayatına bağlanmakta, gerçek hayattan zevk almamaya başlamakta ve kendini gerçek hayattaki sosyal çevresinden soyutlayabilmektedir. Bu nedenle yeni medya rahatsızlıkları teknolojiyi kontrolsüz olarak kullanan ve gerçek dünyayla sanal dünyanın ayrımını yapmakta zorlanan çocuklarda ve gençlerde daha yaygın görülebilmektedir.

Dijital medyada üne kavuşmak oldukça kolaydır. Beden teşhir etme, özel hayatı sergileme, sıra dışı aktivitelerde bulunma gibi bir çok seçenek ile takipçi sayısı arttırarak ünlü olmak mümkündür. Gerçek hayatta yeterince takdir edilmeyen bireylerin sanal alemde abartılı şekilde takdir görmesi, narsistik duyguların güçlenmesine neden olabilir. Yeni medya rahatsızlıklarının çoğunun temelinde de narsisizm yatmaktadır. Narsist bireyler empati olgusundan yoksundur ve başkalarına karşı gerçek hayatta yapamayacakları yıkıcı eleştirileri dijital ortamda rahatlıkla yapabilmektedir. Bu durum günümüzde oldukça sık duyduğumuz “siber zorbalık” kavramını gündeme getirmektedir. Siber zorbalık, dijital medya aracılığıyla kişi yada kişilere zarar vermek olarak tanımlanabilmektedir. İzinsiz fotoğraf paylaşmak, mesajlar ve görüntülerle taciz/tehdit etmek, hakaret etmek, paylaşımlara olumsuz ve yıkıcı yorumlar yapmak, dalga geçmek için kişinin fotoğraflarını veya videolarını kullanmak, hesaplarını ele geçirmek vb. bir çok davranış siber zorbalığa örnek teşkil etmektedir. Bireyler zorbalıklarla karşı karşıya kalmamak için güçlü bir profil oluşturma gereği duymaktadır. Bu nedenle arkadaşlarının/takipçilerinin kim olduğundan daha çok sayısı, gerçek hayattaki yakınlıklarından daha çok kullanıcıyı desteklemeleri önemlidir. Çok sayıda takipçiye/arkadaşa sahip olmak bir statü sembolüken arkadaş/takipçi sayısının az olması tersi etki yaratmakta ve utanç verici kabul edilebilmektedir.

Bu çalışmada yeni medyanın bilinçsiz veya aşırı kullanımının neden olduğu fare-klavye hastalığı, Ego Sörfü, Google Takibi, Siberhondrik, Photolurking, Crackberry, Cheesepodding, Blog İfşacılığı, Nomofobi, Hikikomori, FOMO, Youtube Narsisizmi, Myspace Taklitçiliği, Wikipedializm gibi rahatsızlıklar ile ilgili literatür taraması yapılmış olup bu rahatsızlıklar ile ilgili bazı öneriler sunulmuştur.

2.YENİ MEDYA VE ORTAYA ÇIKARDIĞI RAHATSIZLIKLAR

Günümüzde, yeni iletişim ortamları yeni medya olarak adlandırılmaktadır. Yeni medya, psikolojik, sosyal, kültürel, politik ve ekonomik konular üzerine çalışan araştırmacıların 1970'lerde bilgi ve iletişim teknolojilerine yönelik araştırmaları sonucunda ortaya çıkmış bir kavramdır. Kısaca farklı dijital ortamları bir araya getiren yeni iletişim ortamları, ses ve görüntünün ve metin gibi farklı teknik uygulamaların bütünlüğünden oluşmaktadır. Yeni medyanın "yeni" olarak ele alınmasının temel nedenlerinden birisi içinde bulunulan dönemin, ekonomik, sosyal, kültürel seviyesi ve anlayışıdır.

Yeni medya kavramının geçmişi 1970'lere kadar dayanmaktadır. Bu yıllarda bilgi ve iletişim tabanlı araştırmalarda, psikolojik, sosyal, kültürel, ekonomik ve politik çalışmalar yapan araştırmacılar tarafından üretilmiş bir kavramdır (Dilmen, 2007: 114). Ancak kavramın taşıdığı anlam 2000'li yıllara doğru değişim göstermiş ve internet teknolojisi ile birlikte günümüzdeki anlamına kavuşmuştur. Günümüzde yeni medyanın tanımları farklılık gösterse de genel olarak pazarlamacılar ve tüketiciler arasında iki yönlü iletişim için geniş fırsatlar sunan sosyal ağ web siteleri, bloglar, sohbet odaları, tartışma panoları ve müşteri hizmetlerini derecelendiren web siteleri gibi elektronik iletişim kanalları bulunmaktadır (Bernhardt ve Mays, 2012: 132). 2004 yılında Morgan Stanley'nin yaptığı bir araştırmaya göre; 50 milyon kullanıcıya radyonun 38 yıl, televizyonun 13 yıl, internetin ise 5 yılda ulaşabildiği saptanmıştır (Turgut, 2010). Bu doğrultuda yeni medyanın hem zaman hem de olanaklar bakımından diğer medya araçlarına oranla daha üstün özelliklere sahip olabildiği söylenebilir.

Bilgi iletişim teknolojilerinin milenyumla beraber hızlı bir şekilde gelişmesi ile yeni bir kültür ve sistemler bütünü ortaya çıkmıştır. Teknolojik değişim ve dönüşüme en hızlı ayak uyduranlar ise Y kuşağı olmuştur. Y kuşağı yeni teknoloji ile doğan ve bu teknolojilere alışmayıp bu teknolojilerin olanaklarını ustaca kullanabilen bir özelliğe sahiptir. Bu konuda bu kitlenin çevresinde her çeşit yeni iletişim araçlarının olması ve bu teknolojilerin gün geçtikçe ucuzlaması, ayrıca kullanımlarının daha da kolaylaşması gibi farklı nedenler sıralanabilir. Y Jenerasyonunun taşıdığı 5 karakter özellik aşağıda sıralanmıştır (Syrett ve Lamminman, 2004: 62):

Samimiyet: İnternet üzerinden yakın ilişkiler kurma ve sürdürme becerisini taşıması,

Sadakat: Sıkı korunan kişisel ağlarına ve daha az tutarlı veya güvenilir şekilde markalara ve işverenlere yönelik hissedilen duygulara sahip olması,

Farkındalık: İş içindeki ve dışındaki sosyal meselelerden, şeffaflık, dürüstlük, marka yönetimi veya insan kaynakları stratejilerine kadar farklı konularda kendini güncelleyerek farklı davranabilme bilincinin bulunması,

Denge: Y neslinin, iş ve kişisel yaşam arasındaki çizgide, 7/24 yaşam tarzını benimsemeye hazırlıklı ve istekli olması,

Risk: Sık değişime açık olmaları ve açık, esnek ve mobil olma eğilimlerinin bulunması,

Yukarıda Y nesline yönelik bahsedilen özellikler yeni medyanın kullanımı için tutarlı içeriğe sahiptir. Geçmiş yüzyılda gezgin, seyyah, yolcu, şair veya bohem karakterleri, yerlerini içinde bulunulan dijital çağda “yerinden kalkmadan hareket edebilen” sanal gezginlere bırakmıştır (Köse, 2012: 138). Bu doğrultuda özellikle genç nüfusun yeni iletişim teknolojilerini bağımlılık oranında kullanması, yeni rahatsızlıklar ile karşı karşıya olduğunu/olabileceğini gösterebilir (Adnan, 20016: 145). Bağımlılıklar ise genel çerçevede kimyasal ve davranışsal bağımlılık olarak ikiye ayrılmak, teknoloji bağımlılığı da davranışsal bağımlılıklar başlığında ele alınmaktadır (Olca, 2018: 95).

21. yüzyılın hastalıkları olarak da düşünülebilecek bazı rahatsızlıklar daha çok çocuklarda ve gençlerde görülmekte ve bu kitlenin bedensel ve psikolojik gelişimlerini olumsuz yönde etkileyebilmektedir. Yeni medya rahatsızlıkları aşırı kullanıcılarında kaygı, korku, huzursuzluk gibi duygular yaratırken, nefes darlığı ve baş dönmesi gibi birtakım fizyolojik yan etkilere de yol açabilmektedir (Duygulu, 2017). Literatür incelendiğinde bu rahatsızlıklara isimlerin verildiği ve belli tanımların yapıldığı görülmektedir. Fisher (2006), Newscientist dergisindeki yazısında Ego Sörfü, Google Takibi, Crackberry, Cheese podding, Blog İfşacılığı, Myspace Taklitçiliği gibi rahatsızlıkları belirtmektedir. Psikolog Duygulu (2017) ise bunlara ek olarak Fomo, Nomofobi, Stalklama, Photolurking, Siberhondrik gibi kavramlardan bahsetmektedir. Bu rahatsızlıklara ilişkin ayrıntılı bilgiler aşağıda yer almaktadır.

Fare-klavye Rahatsızlığı: Mouse ve klavye kullanılarak sürekli yapılan aynı hareketler sonucu el bileklerinde uyuşma ve ağrı ile kendini göstermektedir. Bir tür sinir sıkışması rahatsızlığı olarak ifade edilebilir. Genel olarak yeni medya kullanıcısı günde ortalama 7000-8000 tıklama yapmakta ve fareyi yaklaşık 1 km. olduğu yerde hareket ettirmektedir (Sabah Gazetesi, 2018). Fare klavye hastalığı bazı kaynaklarda karpal tünel sendromu olarak da geçmektedir. Fare klavye hastalığı ile bileklerde sızı hissetme ve bir süre sonra el hareketi ile ağrılar oluşma, sonraki aşamada el eklemlerinde ödem oluşması ile karşılaşılabilir. Aşırı fare klavye kullanımı ile kendisini gösteren bu rahatsızlık aynı zamanda yanlış kullanımlar sonucu da ortaya çıkabilmektedir. Klavyenin bilgisayar tarafının yüksek olması engellenmeli ve mümkün olduğu ölçüde düz kullanılmalıdır. Ayrıca aynı düz kullanım fare için de geçerlidir.

Ego Sörfü (Egosurfing): Belli aralıklarla dijital ortamda kendi ismiyle arama yapan ve hakkında dijital ortamda hangi bilgilere ulaşıldığını inceleyen kişilerin yakalandığı rahatsızlıktır (Özsoy, 2009: 652). Ego sörfü “online narsizm” olarak da adlandırılabilir. Narsizm kişinin kendisine karşı gereğinden fazla düşkünlüğü ve kendisine yönelik hayranlık boyutundaki abartılı hissidir. Ego sörfü veya online narsizm de kişinin kendine yönelik aşırı beğenme hissini dijital ortam üzerinde devam ettirmesi olarak

açıklanabilir. Ayrıca kullanıcıların kendilerine ilişkin paylaşımları, yorumları, beğenileri ve takipleri sürekli kontrol etmesi bu hastalığın yansıması olarak görülebilir (Kısaç ve Şensoy, 2017: 381).

Enfornografi (Infomani): Kavram “ilk olarak 1980’lerde ortaya çıkmıştır”(Aras, 2009). “Pornografi ve enformasyon kelimelerinden türetilmiş bu kavram, “kişilerde bulunan bitmeyen bilgi ihtiyacını dijital ortamda gidermeye çalışma” olarak tanımlanmaktadır (Özsoy, 2009: 652). Günlük hayatta birçok insan herhangi bir konuda yeni bilgilere ihtiyaç duymakta ve bu bilgiler için en kısa yoldan interneti kullanmaktadır. Bir durumun enfornografi olarak ifade edilmesi için kişinin sürekli ve aklına gelen her konuda yeni medyayı kullanması veya kullanmak istemesi gerekmektedir. Bu kavramın tanımına giren insanlar, cep telefonu veya bilgisayar aracılığı ile yeni bilgileri kontrol etmek veya toplamak için güçlü bir güdüsel istek duymaktadırlar.

Google Takibi / Stalklama: Yeni medya kullanıcılarının belli periyotlarla arama motorlarından istediği kişiler hakkında bilgiye onun isteği dışında gizli incelemeler yapmasını ifade etmektedir (Kısaç ve Şensoy, 2017: 381). Diğer bir tanıma göre “birilerini yasa dışı olarak takip etme veya seyretme suçu” olarak nitelendirilebilmektedir (Cambridge Online Dictionary). Kullanıcı Google takibi yapacağı kişinin neler yaptığını, gününü nasıl geçirdiğini, hayatındaki değişiklikleri sürekli olarak takip etme ve bilme isteği içindedir. Bu durum yeni iletişim teknolojilerinin gelişmesi ve ulaşılabilirliği ile beraber artmaktadır. Örneğin BBC Muhabiri Tom Edwards’ın (2018) haberine göre Herefordshire ve Worcestershire bölgelerinden bildirilen olayların sayısında, son 12 ay içinde neredeyse 300 vakaya rastlanan stalklama ile ilgili büyük bir artış olmuştur.

Siberhondri (Cyberchondria): Web’de arama sonuçlarının ve literatürün gözden geçirilmesine ilişkin asılsız endişe artışını ifade etmektedir (White ve Horvitz, 2009: 1). Siberchondria terimi, 1999’dan beri İngiltere’de Harris Interactive’in (Harris Poll, 1999; Ivanova, 2013: 60) internette sağlık hakkında bilgi edinmek için yaptığı çalışmalarda kullanılmıştır. 2000’li yıllardan sonra Times gazetesinin haberleri ile dikkat çekmiş ve izleyen yıllarda da teknolojinin gelişmesi ile birlikte kelimenin kullanırlığı artmıştır (Korucu, Oksay ve Kocabaş; 2018: 212). Siberhondrik olarak bilinen bozukluk, somotoform bozukluklardan Hipokondriazis’in bir çeşidi olarak ele alınmaktadır (Yavuz, 2014). Ufak bir hastalık belirtisinde, uzman bir doktora gitmek yerine dijital ortamdan çözüm veya tedavi yöntemleri aramak için kullanılmaktadır (Ceritli ve Bal, 2017: 478). Siberhondrikler, sahip olduğunu düşündükleri rahatsızlık hakkında dijital ortamda herhangi bir enformasyon, çözüm veya tedavi yöntemlerine bakarak kendilerine tanı koymaya çalışmaktadırlar. Bu süreçte eksik kalan bir bilginin olup olmadığı konusunda endişe yaşamakta ve araştırmalarını yinelenmektedirler. Farklı önemsiz hastalık belirtisi veya duydukları hastalığa ilişkin endişe duymakta ve kendilerinde olabilme ihtimalini düşünerek farklı doktorlara gitmektedirler. Muayenelerde herhangi bir sorun çıkmaması durumunda internetten hastalık belirtilerine bakarak o hastalığa sahip olabileceklerini düşünmekte ve “doktorlar anlamadı” ifadesi ile kendilerini

rahatlatmaktadır. Ayrıca hastalıklara yakalanmamak için önlem amaçlı çeşitli vitamin vb. hapi almakta ve doğal besinlere yönelebilmektedirler.

Photolurking: Photolurking, bireyin yeni medya ortamlarından herhangi bir ağda tanıdığı veya tanımadığı kişilerin fotoğraflarına saatlerce bakarak zaman geçirmesi ve bunu farkında olmadan sürekli yapmasını ifade etmektedir (Kısaç ve Şensoy, 2017: 381). Aynı durum kapsamında kullanılan Photolurker ise İngilizce'de Fotoğraf (Photograph) kelimesi ile "gizli meraklı" anlamına gelen "lurker" kelimesinin birleşimiyle "fotoğraf dosyalarına bakan meraklı kişi anlamına gelmektedir (Olca, 2018: 96-97). Photolurkerlerin bu durumda olmaları kişisel saplantılar, boş zaman sıkıntısı, depresyon, aşağılık kompleksi, benlik ile ilgili sıkıntılar gibi farklı başlıklarda açıklamak mümkün olabilir.

Crackberry Bağımlılığı: CrackBerry 2006'da yılın kelimesi olarak bilinmektedir (Genosko, 2013: 147). Amerika'da Blackberry ile tuvalet, banyo, yatak da dâhil olmak üzere her yere giden veya cenazede, toplantıda, derste bile telefonlarını sürekli kontrol eden kişilerin Blackberry bağımlılığını ifade etmek için kullanılmaktadır (Sabah Gazetesi:2018). Günümüzde ise kavramın anlamı genişlemiş ve farklı türdeki telefonlar ile de aynı durumun yaşandığı durumlarda bu kavramdan bahsetmek mümkün hale gelmiştir. Özellikle yöneticilerin bu rahatsızlıktan muzdarip olduklarını söylemek mümkündür.

Cheesepodding: Yeni medya kullanıcılarının dinleyemeyeceği kadar çok MP3 veya benzer videolar indirmesi ve bunu her fırsatta devam ettirmesi anlamına gelmektedir. Bu durum bazı isanlar tarafından koleksiyonculuk olarak görülmektedir (Işıkdere, 2016) ancak Cheesepodding rahatsızlığına sahip olan kişiler her farklı fırsatı dijital ortamdan video indirmek için kullanabilmektedir. Örneğin ders veya toplantıda, bir hasta yakını için hastanede, telefonun video indirmesi için komut verilmektedir. Terabyte seviyesinde arşivler edinilmekte ancak bu arşivin büyük bir kısmı kullanılmamaktadır.

Blog İfşacılığı (Blog Streaking): "Bilinmemesi ve yayılmaması herkes açısından faydalı olan bilgileri çevrimiçi yayınlama merakı" (Hürriyet Gazetesi, 2007) veya herkesin merak ettiği gizli veya kişisel bilgileri gözler önüne serme durumu olarak tanımlanabilir. Blog ifşacıları, gizli sayılabilecek bilgilerin çoğunun başka kişiler tarafından merak edildiğini ve öğrenilmesi gerektiğini düşünmektedirler. Bu nedenle yaptıkları işin kamuya faydalı olduğunu ve birilerinin yapmasının gerektiği fikrinden hareket etmektedirler. Son yıllarda dünya çapında, uzaylılar, uzaylıların dünyadaki kampları, gelişmiş ülkelerin ayın karanlık yüzündeki üsleri, bazı sanatçı veya ünlü insanların özel hayatlarına ilişkin fotoğraf, video, anı gibi bilgilerin, çoğu durumda resmi ve somut bir kaynağa dayandırılmadan veya kimseden izin alınmadan internette paylaşılması örnek olarak gösterilebilir.

Nomofobi (Nomophobia): Nomofobi terimi, cep telefonu fobisi için kullanılan bir kısaltmadır ve ilk olarak 2008'de İngiltere Postanesi'nin cep telefonu kullanıcılarının sahip olduğu endişeleri araştırmak için yaptığı bir çalışma sırasında ortaya çıkmıştır (Securenvoy, 2012). İngilizce'de "No Mobile Phone" kelimelerinin birleşmesinden oluşmuştur. King ve arkadaşları (2013: 141) nomofobiyi,

sanal iletişim cihazlarını alışkanlık olarak kullanan bireylerin, bir cep telefonu, MP, PC ya da herhangi bir sanal iletişim aracının bulunmamasının neden olduğu rahatsızlık veya endişeyi tanımlamak için kullanmıştır. Bu rahatsızlığa sahip olan kişilerin, telefonları yanlarında olmadığı veya telefonlarına ulaşamadıklarında kendilerini eksik ve kötü hissetmeleri, stres veya panik yaşamları veya telefonları ile birlikte sürekli telefonlarını kontrol etme isteklerinin olduğu görülmektedir (Öz ve Tortop, 2018: 147). Bu belirtileri gösteren kişinin birinci evrede olduğu söylenebilir. Akıllı mobil cihaz kullanımı arttıkça beyne dopamin salgılayan mutluluk hormonunun arttığı görülebilir. Kullanıcıya mutluluk hissi veren hormonlar, kişinin cihazına bildirim geldikçe salgılanıyorsa bu durum bağımlılık evresinin arttığını göstermektedir (Polat, 2017: 168).

“Bu araştırmaya katılan 2100 akıllı telefon kullanıcısı bireyin yarısından fazlasının nomofobi rahatsızlığına yakalanmış oldukları tespit edilmiştir. Aynı araştırmada erkeklerin kadınlardan daha fazla nomofobi riski taşıdığı da ortaya koyulmuştur. Erkek katılımcıların %58’i ve kadın katılımcıların %48’i akıllı telefonlarını batarya veya kontör bitmesi, çalınma veya kapsama alanı dışında olmaktan ötürü kullanamadıklarında endişe hissettiklerini bildirmişlerdir. Söz konusu araştırmada katılımcıların yarısından fazlası akıllı telefonlarını hiç kapatmadıklarını ve her beş dakikada bir akıllı telefonlarının çalışır vaziyette olup olmadığını veya herhangi bir arama veya mesaj olup olmadığını kontrol ettiklerini bildirmişlerdir. Başka bir araştırmada ise katılımcıların gün içerisinde ortalama 34 kez telefonlarını kontrol ettikleri tespit edilmiştir” (Daily Mail’den aktaran; Erdem, Türen ve Kalkın; 2017: 4).

Yukarıdaki araştırma sonuçlarından da anlaşılacağı gibi nomofobiklerin bu durumları sosyal hayatlarını bazı durumlarda etkileyebilir ve çalışanlar için çeşitli sıkıntılara sebep olabilir. Bu durum bazı klinik bulgularla desteklenerek bağımlılık kategorisinde değerlendirilebilir.

Hikikomori: Hikikomori, var olunan dünyanın yerine yeni medya üzerinde sosyal hayatlarını yaşayan kişiler için kullanılan Japonca bir kelimedir. Kelimenin anlamı “dünyadan çekilme ve yalnız bir hayat sürmek” olan hikikomori günümüzde gerçek hayat yerine yeni medyada yaşamak anlamında kullanılmaktadır (Karal, Fiş Erümit ve Erümit, 2018: 27). Resmi anlamda ilk olarak Japonya’da tanımlanan hikikomori, bir grup bireyin kendilerini evlerine altı aydan fazla bir süre için kapattıkları durum için söylenmiştir (Dziesinski, 2003). Hikikomori olarak ifade edilen kişiler, çevrimiçi oyun oynamak, web sitelerini gezmek, blog okumak, diğer kullanıcılarla sohbet etmek gibi davranışlar sergilemektedir (Hackley, Hackley, Bassiouni, 2018: 58). Kapılarının önlerine aile bireyleri veya ilgili kişiler tarafından konulan yemeklerle yeme ihtiyaçlarını gidermektedirler. Tuvalet ihtiyaçlarını ise en geniş zaman aralıklarında gidermektedirler. Bu tür kişilerde Majör depresif’ten bahsedilebilir ve depresyon sosyal izolasyonun kaynağını açıklayabilir (Teo, 2013).

FOMO (Fear of Missing Out): Bu rahatsızlık yeni medya kullanıcısının sosyal ağ hesaplarındaki gündemi takip edememesinden ve kaçırmasından dolayı hissettiği kaygı ve korku durumunu ifade

etmektedir. Kullanıcı gelişmeleri kaçırdığında büyük bir kayıp yaşadığını düşünmektedir. Yeni medyada yakın çevresinin gün içerisindeki paylaşımlarını bilme isteği yüksek seviyededir ve bu nedenle sürekli sosyal ağların ana sayfalarını kontrol etme isteğine sahiptir. Yeni medya kullanıcısı bu isteğini karşılayamadığı zamanlarda gerginlik hissetmekte ve kaygı derecesi artmaktadır (Kısaç ve Şensoy, 2017: 381). Hesabı bulunan sayfayı sürekli yenileme gereği hissedebilir, sosyal ağlarda çevrimiçi olunmadığında mutsuz olabilir, fikir veya görsel gibi herhangi bir paylaşımın beğeni almaması durumunda duygusal çöküntüye girebilir. Ayrıca kullanıcının hayatında önemli olmayan konular için de aşırı duyarlılık ve sinirlilik bu rahatsızlığın belirtileri olarak ele alınabilir (Sivri, 2015).

Youtube Narsisizmi: (Youtube-Narcissis): Narsisizm kişinin kendisini aşırı seviyede beğenmesi, aşırı öz saygısının olması, muhteşem olduğuna inanması ve teşhircilik yapması anlamına gelmektedir (Suzana Amad, 2015: 31). Narsisizm psikanalitik literatürde önemli bir yere sahiptir. Freud'un narsisizme yönelik davranışsal açıklamaları aşağıda yer almaktadır (Raskin ve Terry, 1988: 890):

Kişinin kendisine yönelik sevgisi, kendini beğenme ve kendini diğerlerine göre büyük görme de dâhil olmak üzere kendine yönelik abartılı tutumlar içinde olması.

Bir kişinin, sevdiklerinin terk etmesi ve başarısızlık korkusunu içeren benlik saygısı ile ilgili çeşitli korkulara veya savunmasızlıklara sahip duygular içinde olması.

Kendini beğenmişlik, ideal olana öykünerek ideal görünmeye çalışma, kabul etmeme ve ayrık davranmayı içeren genel bir savunma yönelimine sahip olması.

Kişinin, öz-yeterlilik ve mükemmellik gibi duygulara ek olarak, diğer insanlar tarafından sevgi ihtiyacını karşılamak için de motivasyon kaynağı yaratması.

Bir insanın başkalarıyla olan ilişkilerini nitelendiren tutumlar dizisi.

Youtube Narsisizmi ise yukarıda bahsedilen narsisizm ile ilgili bilgiler temelinde kişinin kendisini tanıtmak için sürekli kendi ve videolarını internet sitelerinde yayınlama, yayınlama (Ceritli, N. Bal 2017: 478), durumunu ifade etmektedir. Youtube kullanıcısı sürekli kendisini gösterme veya yaptığı işleri aktarma eğiliminde olabilmektedir. Ancak yaptığı işleri aktarırken kendisi ile ilgili vurgular yapmaktan keyif alabilmektedir. Bu vurgular zamanla artabilmekte kişi daha çok kendisini öne çıkarmak isteyebilmektedir. Örneğin çektiği videolarına yalnızca sesini ekleyen bir kişi, bir süre sonra görüntüsüyle de yer alabilmektedir. Kişi, yüksek sayıda beğeniden ve pozitif yorumdan büyük mutluluk duymakta tam tersi için ise mutsuzluk yaşayabilmektedir.

Myspace Taklitçiliği (Myspace Impersonation): Bu rahatsızlık, 2003 yılında kurulan Myspace sosyal ağındaki sahte hesaplardan adını almıştır. Sosyal ağlardaki kullanıcıların farklı fotoğraf ve bilgiler ile kendisini başka (genellikle hayal ettiği) bir kişi gibi göstermesi ve farklı bir kimlikte

yansımasını ifade etmektedir (Sabah Gazetesi, 2018). 2000'li yılların başında Myspace üzerinden açılan sahte hesaplarla birçok kişi mahkemelik olmuş ve bu durum gazetelerde haber olarak büyük kitlelere yayılmıştır. Sosyal anlamda büyük önem taşıyan bu durum literatüre Myspace taklitçiliği olarak geçmiştir.

Wikipedializm (Wikipediholizm): Bu rahatsızlığa sahip olanlar, zamanlarının çoğunu wikipedia gibi wikilere katkıda bulunarak geçirmek istemektedir. Türkiye'de bu tür bir eğilim Wikipedia'ya ek olarak Ekşisözlük, Uludağsözlük, İncisözlük gibi kullanıcılarının yazıları ile oluşturulan sosyal ağlara yönelik bağımlılık derecesinde yazma düşkünlüğü olan kişiler için kullanılabilir.

Yukarıda bahsedilen rahatsızlıklar günlük hayat içerisinde birçok kullanıcıda olabilecek rahatsızlıklardır. Bazı durumlarda kişinin kendisi bu rahatsızlıklarla başa çıkabileceği gibi bazı durumlarda da bir psikolog veya psikiyatrist yardımı gerekebilir. Baş gösteren rahatsızlıklar için önlem alınmadığı takdirde zaman içerisinde psikolojik veya sosyolojik büyük sıkıntılar çıkabilir ve kişinin tüm hayatı etkilenebilir. Günümüzde yeni iletişim teknolojilerini gündelik hayattan ayrı düşünmek mümkün değildir ancak doğru kullanmak gerekmektedir. Bu durumun gençler için ne ifade ettiğinin üzerinde ayrıntılı durulmalı, derinlemesine araştırmalar yapılmalı, toplumun ilgisini ve kaynaklarını harekete geçirmek için büyük çabalar sarfedilmelidir. Gençlerin kendi hayatlarını "normal" düzene koymaları için yeniden yeteneklerinin keşfi ve desteklenmeleri gerekebilir (Wong, 2012: 426). Bu doğrultuda Aras (2009) ve Yavuz (2014)'e göre aşağıdaki bazı öneriler bu söz konusu rahatsızlıklar ile başa çıkabilmek için dikkate alınabilir:

Günün belli saatlerinde telefonun veya bilgisayarın internet özellikleri kullanılabilir,

Boş vakitler spor yaparak geçirilebilir veya dışarıya çıkarak harcanabilir,

E-mailler, acil bir durum yoksa belirli periyodlarla kontrol edilebilir,

Gereksiz e-mail göndermeyin. E-maillerinizi kolay okunmaları için kısa tutun

Yapamıyorsanız, internete bağlanamayan bir telefona geçilebilir veya en azından iş saatlerinde kullanılabilir,

Telefona yeni uygulamalar yüklenmeyebilir

Kampanyalı internet paketinden çıkılarak artan faturalar internetten uzak durmayı sağlayabilir,

Mail kutusu boş tutulmaya çalışılabilir,

Fiziksel tetkiklerden sonra sonuçların iyi olması bedeninde oldukça sağlıklı olduğu anlamına gelmekte. Bu durumu yalnızca bu çerçevede düşünmek gerekir.

İnternete bakma ihtiyacı olduğunda, belli bir süre için ertelenebilir. Zaman geçtikçe bakma ihtiyacı azalabilir ve beklenebileceği görülebilir.

Dikkat kişinin kendi bedeni, telefonu, bilgisayarı yerine dış dünyaya verilebilir.

Yeni bir konuda hobi edinebilir.

Yukarıdaki öneriler eğer yeni medya kullanıcısı için önem taşımaz ise psikolojik destek almak gerekebilir. Bu doğrultuda profesyonel destek ile yeni medya kullanıcısı bağımlılıktan kurtularak daha önceki hayatına geri dönebilir.

3.SONUÇ

Yeni iletişim teknolojilerinin gelişmesi ile beraber yeni medya günlük hayatta daha fazla yer etmekte ve özellikle gençler olmak üzere birçok kişinin hayatını kolaylaştırmaktadır. Yeni medyanın sunduğu kolaylıklara ek olarak birçok konuda negatif yönünden de bahsetmek mümkündür. Bağımlılık derecesinde kullanılan yeni medya uygulamaları, gündelik hayatın düzenini bozabilmekte, sosyal ilişkileri etkileyebilmekte ve psikolojik sorunlar yaratabilmektedir. Bu konuda yapılması gerekenler olmakla birlikte, çalışmanın literatürü gereği bazıları aşağıda sıralanmaktadır:

Fiziksel olarak bilgisayarın karşısında oturma şekline dikkat edilmeli, sırt dik ve bilgisayarın konulduğu masanın bileklerden yukarıda olmamasına özen gösterilmeli. Ayrıca klavyenin düz olmasına özen gösterilebilir ve gün içerisinde el kaslarını geliştirecek stres topları kullanılabilir.

Hiç kimsenin mükemmel olmadığı unutulmamalı. Kişinin egosunu besleyecek haberlerin dışarıdan birileri tarafından yapıldığı düşünüldüğünde bir süre sonra biteceği göz önünde bulundurulmalı. Yeni medya ortamlarını asıl zenginleştiren kişinin kendisi olduğu ve kendisi olduğu müddetçe bu ortamların değer taşıdığı bilinmelidir.

Dijital ortamda bulunan bilgilerin tamamının doğru olmayabileceği gözden kaçırılmamalıdır. Bazı bilgilerin kötü niyetli kişiler tarafından yazılmış olabileceği düşüncesi ile hareket edilmelidir.

Dijital ortamda başka kişileri takip etmenin yalnızca zaman kaybı olabileceği ve elde edilen bilgilerin çözüm üretmeyeceğinin farkında olunmalıdır.

İnsan sağlığı için en doğru çözümün tıp doktorları tarafından bulunabileceği, sanal ortamdan edinilen bilgiler ile yanlış tanımlar konulabileceği ve bu durumun da ilerleyen dönemlerde hayati önem taşıyan sonuçlar doğurabileceği unutulmamalıdır.

Yeni medyada fotoğraflarına sürekli bakılan tanıdık veya tanımadık kişilerin bu durumdan haberdar olmadıkları, hayranlık üstü bu durumun gerçek dünyada bir değerinin olmadığı, yeni uğraşlar bulmanın gerektiği göz önünde bulundurulmalıdır.

İnsan hayatında çalışmanın ve dijital ortam üzerinden iş halletmenin önemli olduğu, bu ortamda kurulan ilişkilerin birçok işi hallettiği bilinmekle beraber, sosyal ilişkilerin içinde yaşanan hayatta gerçek anlam kazandığı unutulmamalıdır.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

İnsan ömrünün kısa olduğu, arşivde olanlar ile değil yaşanan deneyimlerle hayatın anlam kazandığı göz önünde bulundurulmalıdır.

Birçok gizli bilginin, “belki de gizli kalması” gerekmektedir. Deşifre edilen bilgilerin resmi kaynaklardan edinilmemiş varsayımlara dayanabileceği unutulmamalıdır.

2000’li yıllardan önce insanların yanlarında cep telefonu taşımadığı ve hayatlarında bir eksiklik hissetmedikleri, hayatın cep telefonu olmadan da devam ettiği göz önünde bulundurulmalıdır.

Kişinin odasına çekilerek yalnızlaşması ciddi bir durumdur ve bu konu sosyalleşme ile çözülebilir.

Birilerinin gündemini takip etme peşinde koştururken, kişinin kendi hayat gündemi geçmekte ve zaman herkes gibi bunun peşine düşen yeni medya kullanıcısı için de akmaktadır.

Herkesin iyi ve güzel birçok tarafı ve farklı yetenekleri olduğu unutulmamalı, insanı güzel ve iyi yapan şeyin azmi ve çalışması olduğu göz önünde bulundurulmalıdır.

Hiç kimsenin başkalarının hayatını taklit ederek pozitif sonuçlar elde ettiği ispatlanmamıştır. Bu nedenle kişi, başka birisiymiş gibi davranmak yerine sahip olduğu değerleri öne çıkarmalıdır.

Sosyal ağ kullanıcıları yazılan bilgilere ihtiyaç duyabilir ancak; kişi kendi hayat düzeninden ödün veriyor ise bir sorunun olabileceği düşünülmelidir.

Kişi yeni medya ortamlarına gireceği zamanı kısıtlamalıdır. Belirlenen aralıklarda veya zaman dilimlerinde kullanılan ağlar sorunları önleyebilir.

Dış dünyada yaşanan şeyler göz önünde bulundurularak, eğilim olunan konuda hobiler edinilebilir. Bedenin ve ruhun iyi hissetmesi için spor yapılabilir.

Eve internet bağlantısı kurulmayabilir. Cep telefonunun da eve varıldığında internet bağlantısı kapatılabilir.

Yukarıda bahsedilen önerilere ek olarak bir psikologdan veya psikiyatristten profesyonel destek alınabilir. Çünkü bu tür rahatsızlıklar, kısa sürede tedavi edilmediklerinde uzun süreçte büyük hastalıklara yol açabilmektedir. Ayrıca bazı durumlarda gençler içinde buldukları durumun farkında olmadıkları için aileler daha dikkatli olmalı ve çocuklarının sosyal hayatlarını gözlemleyerek gerekli tedbirleri almalıdır.

KAYNAKÇA

Adnan, M.; Gezgin, D., M. (2016) Modern Çağın Yeni Fobisi: Üniversite Öğrencileri Arasında Nomofobi Prelansı”, Ankara Üniversitesi Eğitim Bilimleri Fakültesi Dergisi, 49 (1): 141-158.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Amad, S. (2015). Self-Esteem and Aggression: The Relationships Between Explicit-Implicit Self-Esteem, Narcissism, and Reactive-Proactive Aggression School of Psychology, Yayınlanmamış Doktora Tezi, Cardiff University, Birleşik Krallık.
- Aras, Y. (2009) Google'a soruyorum: Yoksa Ben Bir İnfomanyak Mıyım? https://www.sabah.com.tr/pazar/hobi/2009/11/15/googlea_soruyorum_yoksa_ben_bir_infomanyak_miym Erişim Tarihi: 12/10/2018.
- Bernhardt, J.M.; Mays, D.; Hall, A.K. (2012) "Social Marketing at the Right Place and Right Time With New Media", *Journal of Social Marketing*, 2 (2): 130-137.
- Cambridge Dictionary, "Stalking", <https://dictionary.cambridge.org/tr/s%C3%B6z%C3%BCk/ingilizce/stalking> Erişim Tarihi: 10/10/2018.
- Ceritli, U. ve Bal, P., N. (2017) Lise Öğrencilerinde Bağlanma Stillerinin Problemleri İnternet Kullanımına Etkisi, *Uluslararası Sosyal Araştırmalar Dergisi*, Cilt: 10, Sayı: 50, ss. 475-483
- Dilmen, N.E. (2007), Yeni Medya Kavramı Çerçevesinde İnternet Günlükleri-Bloglar ve Gazeteciliğe Yansımaları, *Marmara İletişim Dergisi*, Sayı:12 Şubat. 113-122.
- Duygulu, S. (2017) Teknoloji Bağımlılıkları Hayatımıza E Hastalıklar Olarak Girdi, http://www.hurriyetaile.com/yazarlar/serap-duygulu/internet-ve-sosyal-medya-hastaliklari-e-hastaliklar_6481.html Erişim Tarihi: 22/11/2018.
- Dziesinski, M., J. (2003), "Hikikomori: Investigations into the Phenomenon of Acute Social Withdrawal in Contemporary Japan", Available at: <http://towakudai.blogs.com/Hikikomori.Research.Survey.pdf>, Erişim Tarihi: 11/10/2018.
- Erdem, H.; Türen, U. ve Kalkın, G. (2017) "Mobil Telefon Yoksunluğu Korkusu (Nomofobi) Yayılımı: Türkiye'den Üniversite Öğrencileri ve Kamu Çalışanları Örnekleme" *Bilişim Teknolojileri Dergisi*, 10 (1): 1-12.
- Fisher, R. (2006) Just Can't Get Enough, *Newscientist*: <https://www.newscientist.com/article/mg19225831-200-just-cant-get-e-nough/#bx258312B6> Erişim Tarihi: 22/11/2018.
- Genosko, G. (2013) *When Technocultures Collide Innovation from Below and the Struggle for Autonomy*, Canada: Wilfrid Laurier University Press.
- Hackley, C.; Hackley, R., A.; Bassiouni, D., H. (2018) "Implications of the Selfie for Marketing Management Practice in the Era of Celebrity", *Marketing Intelligence & Planning*, 36 (1): 49-62.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Hurriyet Gazetesi (2007) Bunlar da İnternet Hastalıkları, <http://www.hurriyet.com.tr/gundem/bunlar-da-internet-hastaliklari-5747055> Erişim Tarihi: 18/10/2018.

Işıkdere, A. (2016) Sosyal Medya Hastalıkları, <http://bilimdili.com/doga-cevre/tip/sosyal-medya-hastaliklari/> Erişim Tarihi: 14/09/2018.

Ivanova, E. (2013) “Internet Addiction and Cyberchondria Their Relationship With Wll-Being” Journal of Education Culture and Society No: 1: 57-70.

Karal, H.; Erümit, S., F.; Erümit, A., K. (2018) Sosyal Medya İletişimi, (Edt: Emre Ş. Aslan, Erdem Taşdemir) Ankara: Gece Kitaplığı.

Kısaç, İ.; Şensoy, E., M. (2017), Gençlerde Sosyal Medya Algısı ve Kullanma Davranışı, Mediterranean International Conference on Social Sciences, Podgorica, 1 (1): 379-391.

King, A. L. S.; Valença, A. M.; Silva, A. C. O.; Baczynski, T.; Carvalho, M. R. ve Nardi, A. E. (2013). Nomophobia: Dependency on Virtual Environments or Social Phobia? Computers in Human Behavior, 29 (1): 140–144.

Korucu, K., S.; Oksay, A.; Kocabaş, D. Bölüm Adı: Online Health Concern: Cyberchondrica, (Editör: Hakan Kapucu, Cüneyt Akar) Kitap Adı: Changing Organizations From the Psychological & Technological Perspectives, London: IJOPEC Publication Limited, ss. 211-218

Köse, H. (2012). Sanal Gezginin “Ego Sörfü”: Ekran-Gezerlik, İnternette Gezinmek ya da Yolculuk Üzerine Düşünceler. H. Köse (Ed.) Flanör Düşünce: Arkaik Dönemde ve Dijital Medya Çağında Aylıklık (s. 137-162). İstanbul: Ayrıntı Yayınları.

Olçay, S. (2018) Sosyalleşmenin Dijitalleşmesi Olarak Sosyal Medya ve Resimler Arasında Kaybolma Bozukluğu: Photolurking, Yeni Medya Elektronik Dergi, Cilt: 2, Sayı: 2, ss. 90-104.

Öz, H. ve Tortop, H.,S. (2018) Üniversitede Okuyan Genç Yetişkinlerin Mobil Telefon Yoksunluğu Korkusu (Nomofobi) ile Kişilik Tipleri Arasındaki İlişkinin İncelenmesi, Yeni Medya Elektronik Dergisi, 2(3): 146-159.

Özsoy, T. (2009), “Fastfood’dan Facebook’a: İnternet Bağımlılığı”, Akademik Bilişim’09 - XI. Akademik Bilişim Konferansı Bildirileri 11-13 Şubat 2009 Harran Üniversitesi, Şanlıurfa.

Polat, R. (2017), Dijital Hastalık Olarak Nomofobi, Yeni Medya Elektronik Dergi, Cilt: 1, Sayı: 2, ss. 164-172.

Raskin, R., & Terry, H. (1988). A Principal-Components Analysis of the Narcissistic Personality Inventory and Further Evidence of its Construct Validity. Journal of Personality and Social Psychology, 54 (5): 890-902.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Sabah Gazetesi (2018) En İlginç Sosyal Medya Hastalıkları
<https://www.sabah.com.tr/galeri/aktuel/ilginç-sosyal-medya-hastaliklari/2> Erişim Tarihi:
01/12/2018.

Securenvoy a Shearwater Group PLC Company (2012) "66% of the Population Suffer from Nomophobia the Fear of Being Without Their Phone" <https://www.securenvoy.com/en-gb/blog/66-population-suffer-nomophobia-fear-being-without-their-phone>, Erişim Tarihi: 18.11.2018.

Sivri, E. (2015) Sosyal Medya Hastalığının Yeni Adı: FOMO, <https://www.webtekno.com/internet/sosyal-medya-hastaliginin-yeni-adi-fomo-h7102.html>
Erişim Tarihi: 15/11/2018.

Syrett, M., Lamminman, J. (2004) "Advertising and Millennials", Young Consumers, Cilt: 5 Sayı: 4, ss.62-73.

Teo, A., R. (2013) "Social Isolation Associated with Depression: A Case Report of Hikikomori" International Journal of Social Psychiatry, 59 (4): 339-341.

Turgut, Ö., P., İnternet Reklâmlarında Tasarım Sorunları: Banner Reklamlar Üzerine Bir İnceleme, <http://inet-tr.org.tr/inetconf10/bildiri/12.doc>, Erişim Tarihi: 12.02.2010.

White, R.W., & Horvitz, E. (2009). Cyberchondria: Studies of the Escalation of Medical Concerns in Web Search. ACM Transactions on Information Systems, Cilt: 27, Sayı: 4, ss. 1-37.

Wong, V. (2012) "Social Withdrawal as Invisible Youth Disengagement: Government Inaction and NGO Responses in Hong Kong", International Journal of Sociology and Social Policy, 32 (7/8): 415-430.

Yavuz, M. (2014) Siberhondrik Nedir, Nasıl Bir Hastalıktır?
<https://hthayat.haberturk.com/saglik/haber/1022931-siberhondrik-nedir-nasil-bir-hastaliktir>
Erişim Tairhi: 12.10.2018.

ÇEVRESEL MALİYET RAPORLAMANIN REKABET AVANTAJI ÜZERİNE ETKİLERİ

Mustafa ARI*

Gökhan BAYRAM**

ÖZET

Günümüzde işletmeler rekabetin kızışması ile birlikte daha fazla rekabet etmek daha fazla üretmek daha fazla ürün satabilmek ve daha fazla kar elde edebilmek için çevresel maliyetlere yüklenmek istememektedirler. Fakat toplumların refah düzeyleri artmasıyla müşteriler çevreye duyarlı üretim talep etmektedirler. Bu durumda müşteri taleplerini karşılamak açısından işletmeler daha fazla çevresel maliyetlere katlanmak yükümlülüğü hissetmektedirler. İşletmeler çevreye duyarlı ürünleri üretebilmek için çeşitli çevresel maliyetlere katlanmak zorunda kalıyorlar. İşletmelerin karşılaştığı çevresel maliyetlerin artması ve çevresel maliyetlerin yönetimi çok önemli hale gelmiştir. Çevresel maliyetlerin avantaja dönüştürerek yönetilebilmesi çevresel raporlama ile mümkün olabilir. İşletmelerin artan çevresel maliyet sorunlarını çözebilmeleri ve hatta çevresel maliyetleri rekabet avantajına dönüştürerek çözebilmeleri için çevresel raporlama önerilmektedir. Çevresel raporlama ile paydaşlar özellikle müşteriler işletmenin çevreye duyarlı ürünler üretmek için katlanmış olduğu çevresel maliyetleri hakkında bilgilendirileceklerdir. Bu durumda tüketiciler gönüllü olarak daha fazla fiyat ödemeye razı olabileceklerdir. Bu durumun işletmelerin katlanmış olduğu çevresel maliyetlerin yönetimine olumlu katkılar sağlayacağı, çevresel raporlamayı yapan işletmelerin raporlama yapmayan işletmelere göre rekabet avantajı sağlayacağı literatür incelemesi yöntemi ile ortaya konmaya çalışılmıştır.

Anahtar Kelimeler: Çevresel Raporlama, Çevresel Maliyetler, Çevresel Maliyet Yönetimi, Rekabet Avantajı, Rekabet Unsurları

EFFECTS OF ENVIRONMENTAL REPORTING ON COMPETITIVE ADVANTAGE

ABSTRACT

Nowadays, businesses do not want to be more competitive to compete with the competition, to produce more products, to be able to sell more products and to gain more profits. However, with the increase in the welfare of societies, customers demand environmentally friendly production. In this case, in order to meet customer demands, businesses feel the obligation to bear more environmental costs. Businesses have to bear various environmental costs in order to produce environmentally sensitive

* Bilecik Şeyh Edebali Üniversitesi, İ.İ.B.F. İşletme Bölümü, Bilecik, Türkiye, mustafa.ari@bilecik.edu.tr

** Kocaeli Üniversitesi, S.B.E. Muhasebe Finansman, Kocaeli, Türkiye, gokhanbayram1165@gmail.com

products. Increasing environmental costs faced by enterprises and managing environmental costs have become very important. Environmental reporting can be achieved by turning environmental costs into advantages. Businesses are encouraged to solve environmental problems by increasing environmental costs and even environmental reporting to solve environmental costs by turning them into competitive advantages. With environmental reporting, stakeholders will be informed, in particular, of the environmental costs of which the business has folded to produce environmentally friendly products. In this case, consumers may be willing to pay more prices voluntarily. This situation has been tried to be revealed by the literature review method, which will provide positive contribution to the management of the environmental costs in which the enterprises are folded.

Keywords: *Environmental Reporting, Environmental Costs, Environmental Cost Management, Competitive Advantage, Competitive Elements*

1.GİRİŞ

Çok hızlı bir değişimin yaşandığı günümüz dünyasında teknolojinin gelişmesi ve rekabetin artması ile birlikte işletmeler daha fazla ürün üretmek, satmak ve kar elde etmek için çevresel maliyetlere yüklenmek istememektedirler. Fakat günümüzde toplumların refah düzeyleri artmasıyla insanoğlunun çevresel konularda ulaştığı bilinç düzeyi önemli bir noktaya ulaşmıştır. Hızlı değişen dünya düzeni sonucu küresel iklim değişikliği, çevre kirliliği, dünya insanın yaşamını tehdit eder hale gelmesi gibi birçok çevresel sorunlar da ortaya çıkmıştır. Bu bağlamda müşteriler çevreye duyarlı üretim talep etmektedirler. İşletmelerin çevreye duyarlı ürün yapmalarının gerekliliği ortaya çıkmıştır. Bu açıdan baktığımızda ilk olarak işletmelerin çevreye duyarlı ürünleri üretmek için çevresel maliyetlere katlanmaları bir dezavantaj gibi gözükse de paydaşların özellikle müşterilerin gözüyle ilgili işletme imajını, prestijini ve değerini artıracakları düşünülerek, dezavantaj olarak görülen maliyetlerin rekabet avantajına dönüştürebileceği ortaya çıkmıştır.

Rekabet kavramı, "müşterileri işletmelerin kendilerine sunduğu mal ve hizmetleri alternatifleri karşısında tercih etmesini sürdürülebilir bazda sağlayabilme yeteneği ve gücü" olduğu görüşü geniş ölçüde kabul görmektedir. Rekabet gücü, bilimsel ortamlarda oldukça sık kullanılan, tartışılan ancak net tanımı üzerinde tam bir mutabakatın olmadığı, farklı anlamların yüklendiği bir kavramdır. Rekabet ve rekabet gücü tanımlamasında veya ölçülmesinde görülen temel zorluk, rekabetin ve ortaya çıkan güç kavramının ülke, bölge veya iktisadi oluşumlar açısından farklılık göstermesidir (www.iktisadi.org).

Rekabet, bir işletmenin rakipleri ile karşılaştırıldığında müşterisine daha düşük maliyet ya da farklılık sunmasından kaynaklanan konumsal üstünlüktür (Porter, 1985). Bir işletmenin daha iyi müşteri değeri sunumu sayesinde rakiplerine karşı pazar üstünlüğü el etmesidir (Evans, 2002: 83). Rekabet, bir işletmenin müşteri isteklerini diğer işletmelere göre daha iyi karşılaması, ürün ve hizmetleri daha ucuz

olarak sağlaması olarak tanımlanabilir (www.yonetselzihin.com). İşletmelerin yaşamlarının devamı için gerekli olan olgulardan biri de rekabettir. Globalleşmenin etkisi ile rekabetin hem yoğunluğu hem de çeşitliliği artmıştır (Tekin ve Ömürbek, 2004).

Rekabet avantajı; bir işletmenin diğer işletmeler karşısında sunmuş olduğu mal ve hizmetler sayesinde rakiplerin ve potansiyel müşterilerin gözünde eriştiği maddi ve manevi üstünlüktür. Bu konunun işletmelerde bilimsel olarak araştırılması da rekabet gücünün sürdürülebilirlik derecesi, rakipleri tarafından kopyalanabilirliği ve başka işletmelere transfer edilip edilemeyeceği konularına bakıldığını belirtilmiştir. Eğer yukarıdaki üç kıstas işletme lehine ise, işletmenin rekabet gücünün yüksek olduğu ve işletmenin ciddi bir rekabet avantajı bulunduğu ileri sürülebilir. Aksi halde işletmenin ciddi bir rekabet gücünün olmadığı kabul edilmektedir (Okumuş, 2002: 360).

Rekabet gücü, firmalar açısından, arz etmiş oldukları ürün ve hizmetlerin alternatifleri karşısında tercih edilmesini sürdürülebilir olarak sağlayan bir yetenek olarak tanımlanmaktadır. Ekonomik anlamda başarılı olmak ve rekabet gücü elde etmek, sürekli yenilik yapmayı ve rakiplere göre daha farklı ürün ve ürünler geliştirerek pazar payını korumayı gerektirmektedir. Mevcut stratejilerini, ucuz işgücü, standart ürün felsefesi ve sadece düşük fiyat üzerine kuran tüm ülkeler ve firmalar uluslararası rekabet gücünü kaybedecektir. Yüksek kalitede düşük fiyata dayalı, seri üretim yapan, aynı zamanda müşteri tercihlerindeki değişimleri görebilen ve müşteriye rakiplerin sunamayacağı çok farklı yararlar sunabilen ülkeler ve işletmeler rekabet gücü sıralamasında üst sıralarda yer almaya devam edeceklerdir (Bahar ve Kozak, 2012: 25-36).

Çevreye duyarlı ürünler üreten işletmeler, rekabet avantajını artırabilmek ve rekabet üstünlüğünü pekiştirmek için çevreye duyarlı ürünler ile ilgili katlandıkları maliyetleri, yatırımları ve faaliyetleri hakkında bilgilendirmeleri paydaşlara aktarmalıdır. Bu da işletmenin kendisine özgü temel yetenekleri içerisinde rekabet üstünlüğü sağlayan "Temel Yetenek" içerisinde yer alan çevreye duyarlı ürünler üretmesine, yeşil hareket olarak adlandırdığımız çevreyi korumaya yönelik yatırımlara ve faaliyetlere yönlendirmesine neden olmuştur.

Bu çalışmanın amacı işletmelerin sürdürülebilir rekabet üstünlüğünün önemli bir kaynağı olan "Temel yetenek" kavramı kapsamında çevreye duyarlı ürünler üretmenin çevresel raporlama ile paydaşlara özellikle müşterilere anlatılarak, işletmenin temel yeteneğinin pekiştirileceği düşünülmektedir.

2.ÇEVRESEL RAPORLAMA İle ELDE EDİLEN REKABET AVANTAJLARI

İşletme yönetimi geleceğe dair plan yaparken muhasebe bilgi sisteminden faydalanmaktadır. Muhasebe bir bilgi sistemi olarak istenilen bilgileri oluştururken belirli ilke ve prensip çerçevesinde hazırlamak zorundadır. Bu ilkelerden biri "rapor etmek"dir. Rapor etme, muhasebe bilgi sisteminin ürettiği bilgileri uygun raporlar haline getirerek ve özetleyerek ilgili kişi ve kurumlara sunma işlemidir.

Çevresel raporlar, işletmeye ait çevresel bilgileri paydaşlara aktarmaya yarayan bilgi sisteminin bir parçasıdır (Yağlı, 2006: 84).

Çevresel raporlama bir işletmenin çevre üzerine etkileri, bu etkileri çevre yönetme performansı ve ekolojik bakımdan sürdürülebilir kalkınmaya katkısı dahil çevresel performans bilgisinin ilgili taraflara iletilmesi olarak tanımlanabilir. Çevresel raporlamanın amacı ise işletmenin çevresel etkileri ve çevresel performansı hakkındaki bilgilerin işletme ile ilişkilerini değerlendirmeleri amacıyla ilgili taraflara (paydaşlara) iletilmesini sağlamaktır (Uluslan, 2009: 184-185). Çevresel raporlamanın amacı, yatırımcılar ve raporlamayla ilgilenen diğer taraflar için faydalı olacak şekilde işletmenin çevresel etkileri ve faaliyet performansı hakkında bilgilendirme yapılmasını sağlamaktır (Ayrıçay, Karataş, 2008: 291). Çevresel raporlama işletmelerin çevre ile ilgili yaptıkları sosyal sorumluluk projelerinin, çevresel politikalarının, stratejilerinin, çevresel hedeflerin, çevresel maliyetlerin, çevresel performanslarını denetlenmiş ya da denetlenmemiş çevresel bilgilerinin açık, şeffaf, doğru bir biçimde kamuoyuna açıklanmasıdır (Uluslan, 2009: 184). Çevresel raporlama ile açıklanan bilgiler işletmenin ortakları ve gelecekteki yatırımcıları açısından büyük önem arz etmektedir. Bilgi kullanıcıları karar alma süreçlerinde işletmenin finansal raporlarda yer alan bilgiler tek başına yeterli olmayıp aynı zamanda işletmenin gelecekte ortaya çıkabilecek tüm durumları hakkında bilgi sahibi olmak isterler (Pamukçu, 2011: 133).

İşletmelerin çevresel performansları ile ilgili değerlendirilebilecek önemli araçlardan biri olan çevresel raporlama, bir işletmenin çevre üzerine etkileri, bu etkileri yönetme performansı ve ekolojik bakımdan sürdürülebilir kalkınmaya katkısı dahil çevresel performansı hakkındaki bilgilerin kamuya açıklanmasıdır. Proaktif çevre yaklaşımında işletmelerin çevresel bilgilerinin açıklanmalarıyla hem işletme düzeyinde hem de endüstri düzeyinde bir farkındalık yaratmak istenmektedir. İşletmelerin çevresel iletişim aracı olarak kullandığı çevresel raporlamaya doğru nispeten artan eğilim olduğu görülmektedir. Ancak, bu raporlar daha sıklıkla büyük işletmeler tarafından hazırlanmaktadır. Küçük ve orta ölçekli işletmelerin birçoğu bu raporların maliyetinin çok yüksek ve faydasının ise çok düşük olduğunu düşünmektedirler (Uluslan, 2009: 182-184). Günümüzde toplumların refah düzeylerinin artmasıyla birlikte, müşteriler çevreye duyarlı ürünleri daha fazla talep etmeye başlamışlardır. Bir ürünün çevreye duyarlı olup olmadığını, bir işletmenin çevreye duyarlı ürünler üretilip üretilmediği, çevresel raporlama ile ortaya konabilir.

İşletmeler sosyal sorumluluk bilinci ile topluma faydalı olmak çevre ile ilgili olaylarda daha duyarlı davranmaktadırlar. Böylelikle işletme dış çevreden gelecek olan baskıları önlemek ve çevreci bir imaj yaratmak için çevresel kontrol ve çevresel raporlama yapmaktadır (Taşdemir, 2011: 67). Çevrenin önem kazanması ve sosyal sorumluluk gereğince işletmelerin çevre ile ilgili katlanmış oldukları tüm fedakarlıkları çevresel raporlama da yer alması işletmelerin rekabet avantajına olumlu katkılar sağlayacaktır.

Çevrenin önem kazanması ve sosyal sorumluluk gereğince işletmelerin finansal tablolarında çevresel bilgilerde yer alma gerekliliği ortaya çıkmıştır. Çevre faaliyetleri ile ilgili bilgiler kolayca ulaşılabilir ve raporlanabilir şeklinde olması gerekir. Günümüzde şirketlerin çevre konuları ile ilgilenmelerinin temelinde yasal zorunluluklar, toplumdaki çevre bilinci nedeniyle baskılar, elde edilecek tasarruf gibi değişik nedenler yatmaktadır. Bu gerekçelerden, önemli biri şirketlerin devamlılıklarını sağlayabilmeleri için gerekli olan karlılık, diğeri ise, bununla bağlantılı olarak şirketlerin kendilerini tanıtabilmeleri, belki biraz da çevreci şirket olarak elde edecekleri şöhretten faydalanmaktır (Gönel ve Atabarut, 2005: 81). Ki bu da işletmeye rekabet üstünlüğü sağlayabilecektir.

İşletmelerin çevreye yönelik faaliyetlerini daha net görebilmek için çevresel raporlar yıllık mali raporlardan ayrı olarak da düzenlenebilir. Finansal nitelikli çevresel bilgilerin ayrıntılı olarak raporlandığı çevresel maliyet raporları, bilgi kullanıcılarının işletmenin çevresel maliyetleri hakkında daha kolay ve daha hızlı bilgi edinmesini sağlayabilir (Altınbay, 2007: 8). Çevresel raporların yararları aşağıdaki şekilde sıralanabilir (Ergin ve Okutmuş, 2007: 157) :

Sektörle ilgili büyük yatırımcıların yatırım kararları alabilmeleri için gerekli verileri oluşturur.

İşletme ile yatırımcı arasındaki iletişimi ve ilişkiyi güçlendirir (Ergin ve Okutmuş, 2007: 157). Çevresel raporlara gerekli önemi veren, çevresel raporlamayı yapan işletmeler, raporlama yapmayan işletmelere göre büyük yatırımcıların tercih etmesi nedeniyle; daha kolay ve daha düşük maliyetli finansman elde edebilecektir. Bu durum üretim maliyetlerine olumlu olarak yansıdığı için çevresel raporlamayı yapan işletmeler fiyat rekabeti açısından daha üstün konuma geçebilecektir.

Rekabet avantajı sağlar.

Bu konuda öncülük yapan işletmenin "ilk uygulayıcı olma etkisi" ile işletmenin toplum içerisindeki saygınlığını artırır (Ergin ve Okutmuş, 2007: 157). Çevresel raporlamayı yapan işletmelerin toplum içerisinde saygınlığının artması; müşterilerin ilgili işletmelerin ürünlerine olan talebi de arttırabileceği için rekabet avantajı sağlayacağı düşünülmektedir.

Hedef belirleme ve dış raporlama, çevrenin geliştirilmesine ve iyileştirilmesine bir süreklilik kazandırır.

İşletme tarafından yüksek çevre standartlarının belirlenmesinin o günkü ve gelecekteki çevre mevzuatına büyük ölçüde katkısı olacaktır (Ergin ve Okutmuş, 2007: 157). Çevresel raporlamayı yapan işletmelerin çevre ile ilgili yasal düzenlemelere uygun hareket tarzı belirleyeceği için konuyla ilgili dava, tazminat ve ceza yükümlülüklerine maruz kalmayacağı ortadadır. Bu durum işletmenin toplum gözünde olumlu bir yere sahip olmasının yanında üretim maliyetlerine olumlu katkılar sağlayacağı için fiyat rekabet avantajı sağlayacaktır.

İşletmeyi çevreye duyarlı bir işletme olarak görmeye başlayan tedarikçiler çevreye duyarlı bu işletme ile çalışmayı tercih eder. Yani, bir bakıma işletmenin pazar olanakları gelişmiş olur (Ergin ve Okutmuş, 2007: 157). Çevresel raporlamayı yapan işletmelerin tedarikçilerin gözünde olumlu yönlerinin artması; ilgili işletmenin malzeme, yedek parça, ticari mal vb. tedariklerin daha kolay ve daha uygun fiyatlarla yapılmasını sağlayabilecek, bu durum işletmenin üretim maliyetlerine olumlu katkılar yaparak, ilgili işletmeye rekabet avantajı sağlayacaktır.

Çevresel maliyetlerin kontrol altına alınmasını sağlar (Ergin ve Okutmuş, 2007: 157). Üretimle ilgili çevresel maliyetler, üretim maliyetine yansıtıldığı için; çevresel maliyetlerin kontrol altına alınması ve yönetilmesi, üretim maliyetlerini azaltarak ilgili işletmeye rekabet avantajı sağlayacağı ortadadır.

Açık ve şeffaf bir iş düzeni ve sağlık koşullarındaki olumlu bilgiler çalışanların motivasyonunu artırır (Ergin ve Okutmuş, 2007: 157). Çalışanların motivasyonunun artması verimi arttıracak, bu da işçilik maliyetlerini azaltarak maliyetleri aşağıya çekerek ilgili işletmenin rekabet avantajı elde etmesine dönüşecektir.

Maliyet azaltımı sağlanır, bu da işletmenin kârlılığına olumlu olarak yansır.

Gelecekte oluşabilecek zararlar önlenerek zarar maliyetleri azaltılabilir.

3. ÇEVRESEL RAPORLAMANIN İŞLETME DÜZEYİNDE REKABET AVANTAJI ÜZERİNE ETKİLERİ

Günümüzde işletmeler sadece kendi çıkarlarını uygun hareket etmemelidirler. Aynı zamanda sosyal sorumlukları anlayışıyla tüm paydaşların beklentisi doğrultusunda ihtiyaçları karşılamaı gerekir. Paydaşlarıyla iyi ilişkiler kuran işletmeler işletme başarısı yakalamış demektir. Dolayısıyla işletmeler sadece finansal anlamda değil, ekonomik, sosyal ve çevresel performansları hakkında da hesap verme gereği duymaktadır (Tokgöz ve Önce, 2009: 257-258). İşletmeleri çevresel raporlamaya iten nedenler bulunmaktadır. Bu nedenler şu şekilde sıralanabilir (Taşdemir, 2011: 75):

İşletmeler çıkar gruplarından gelen baskıları önlemek amacıyla çevresel rapor hazırlamaktadırlar. Çıkar grupları hissedarlar yatırımcılar ve çevre koruma örgütleri olabilir.

İşletmenin çevresel raporlama aracılığı ile toplumda "yeşil işletmeci" imajını elde etmesi, işletme imajının güçlenmesini sağlamaktadır.

İşletmenin karşılaştığı riskler sistematik ve sistematik olmayan risklerdir. Sistematik risk, işletme dışında gerçekleşen işletme tarafından kaynaklanmayan risktir. Bunlar pazar riski, enflasyon riski ve faiz riskidir. Sistematik olmayan risk ise, işletmenin kendisinden kaynaklanan risklerdir. Bunlar, faaliyet

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

riski finansal risk ve yönetim riskidir. Çevresel risk unutulmuş ve her işletmenin karşılaşacağı bir risktir. Bu risk çevresel raporlar sonucunda fark edilebilir.

Çevre raporu hazırlamanın bir diğer nedeni ise işletmenin çevresel performansını görmesi ve ilgili çıkar gruplarına iletmesidir.

Geleneksel finansal raporlar ve açıklamaları ile yetinmeyen işletme dışı gruplar, günümüzde hızla gelişen doğal çevre bilincine paralel olarak, işletmeden ayrıca çevre konularını içeren raporlar istemektedir

Geleneksel raporlama sistemi daha çok parayla ifade edilebilen verileri kabul ederken, parayla ifade edilemeyen verileri dipnotlar vasıtasıyla açıklamakta, açıklayamadığı birçok veri muhasebe sistemi dışarısında kalıp, mali raporlarda yer almamaktadır. İşletmeleri çevresel raporlamaya iten bir diğer sebepten çevresel unsurların ve maliyetlerin açıkça ifade edilemediği bir finansal yapıda bu unsurların ilgili yöntemlerle raporlanmasıdır.

Topluma karşı duyarlı davranarak, etik değerlere ve insan haklarına saygılı bir şekilde çevreye verilen zararı hesaplayarak hareket eden ve bunu paydaşlara (kamuya) paylaşan işletmeler, sürdürülebilir kalkınmanın önemli unsuru olarak görülmektedir (Özkaya, 2010: 249). İşletmeler çevresel maliyetlerin raporlanması sonucu öncelikle paydaşlarına olan sorumluluğunu yerine getirmiş olacak, bunun yanında ayrıca bilgi kullanıcılarına olan güvenilir bilgiler sunmuş olacaktır. Böylelikle işletmenin doğaya ve çevreye karşı sorumluluğunu ne ölçüde yerine getirip getirmediğini çevre raporlaması aracılığıyla açıklanmış olacaktır.

İşletmelerin günümüzde hayatta kalabilmeleri uyguladıkları rekabet stratejilerine bağlıdır. Artık kalıcı ürünler, uzun süre değişmeyen müşteri ihtiyaçları, sınırları belli pazarlar ve net bir şekilde bilinen rakipler yerine yeni ürünler, değişen müşteri ihtiyaçları, kısa ürün yaşam çevrimleri ve küresel pazarlara yönelik rekabet stratejilerinin üretilmesi gerekmektedir (www.yonetselzihin.com).

Rekabet gücü üç farklı bağlamda ele alınabilir. Ülke düzeyinde rekabet gücü dünya kalitesinde ürünler üretip, dünya için geçerli fiyatlar üzerinden küresel pazarlara satabilme yeteneğidir. Endüstri düzeyinde rekabet gücü rakip endüstrilere oranla aynı veya daha yüksek verimliliğe ulaşma ya da aynı veya daha düşük düzeyde üretim yapma veya satma yeteneğidir. İşletmeler düzeyinde rekabet gücü ise işletmenin ürün ve hizmetlerinin tercih edilebilirliğini sürdürme yeteneğidir (www.yonetselzihin.com). Bu çalışmada daha çok işletmeler düzeyinde rekabet gücü incelenmiştir.

İşletme düzeyinde rekabet gücü, herhangi bir işletmenin ulusal ya da uluslararası piyasalarda rakiplerine kıyasla düşük maliyette üretimde bulunabilme (fiyat ve maliyet rekabet gücü), ürünün kalitesi, sunulan hizmet ve ürünün çekiciliği (kalite rekabet gücü) gibi unsurlar açısından rakiplerine denk veya daha üstün bir durumda olma, ayrıca yenilik ve icat yapabilme yeteneğidir (Coşar, 2008: 46).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Bir işletmenin rakipleri karşısında ve rekabet ortamında kaynakların kullanımı veya faaliyet alanı açısından elde ettiği benzersiz konuma rekabet üstünlüğü denir. Rekabet üstünlüğü elde edebilmek için işletmeler kendilerine özgü avantajlar yaratmalı, kolay taklit edilemeyecek özellikler ve yetenekler kazanmalıdırlar. Dolayısıyla değer zincirindeki faaliyetleri rakiplerine göre daha iyi yapmalıdırlar (www.yonetselzihin.com). Çevresel raporlamayı yapan işletmelerin kendilerine özgü avantajlar elde edeceği öngörülmektedir.

Rekabet stratejisi belirli bir pazarda müşteriler için değer yaratan ve temel yetenekler aracılığıyla sürdürülebilir rekabet üstünlüğü elde etmeye yönelik karar ve davranışlar setidir (www.yonetselzihin.com). Çevresel raporlama ile işletmenin çevre ile ilgili faaliyetleri ve yatırımları hakkında müşterilerin bilgilendirilmiş olması; müşteriler için değer oluşturan karar ve davranışlar olarak düşünülmektedir.

Maliyet, kalite, ürün farklılaştırması, yeni ürün, teknolojik farklılıklar, odaklanma ve piyasa yapıları rekabet gücünü yeni belirleyiciler olmaktadır. Porter'a göre rekabet artık üretim üstünlüğü ya da fiyat rekabetinden çok kalite, ürün çeşitlendirmesi, yenilik, modern tasarım ve görüntü ölçüsünde olacaktır. Bugün bütün ekonomiler için geçerli olan, kalite, yenilik, esneklik, hız, farklılık, verimlilik ve mükemmeliyet rekabet gücünün yeni belirleyicileri olmuştur (Akgemci, 2013: 174-176).

Günümüz iş dünyasının en değerli kaynağı olan bilgi, rekabet yapısının belirleyicisi ve işletmelerin yaşamının can damarı haline gelmiştir. Rekabet savaşında ayakta kalmanın ve üstün gelmenin bel kemiğini oluşturan bilginin rekabette ve rekabetin de işletmelerin yaşamındaki önemi giderek artmaktadır. İşletmeler rekabet üstünlüğünde anahtar kavram olan bilgi ve kullanımı için gereğini yapmak zorundadırlar. Çünkü, bilgi ve bilgiye dayalı teknolojiler, müşteri memnuniyeti sağlamada işletmelerin en büyük gücünü oluşturmaktadır. Birçok avantaj sunan ve karşılıklı ilişkileri geliştirmeye yardımcı olan bilginin kullanımı, ürün gelişmesinin belirli bir düzeyinde, müşteri memnuniyetinin en önemli katkı maddesi olmaktadır (Ekinci, 2006: 58). Günümüzde artan rekabet ortamında işletmelerin sahip olduğu değerli faktörlerden biri olan bilgi, işletmelere sürdürülebilir rekabet avantajı sağlamasına ve işletme ile ilgili kararlarda önemli bir unsur olarak görülmektedir. Çevresel maliyet bilgileri de aynı kapsamda düşünülmelidir.

Tüm işletmeler faaliyetleri esnasında çevre kirliliğine neden olmakta ve atıklar üretmektedir. Bu atıklar kullanılan madde ve malzemenin niteliğine göre çevreyi az ya da çok kirletme özelliğine sahip olabilirler. Örneğin cam, kimya, ağaç, çimento, seramik madencilik, kağıt üretim ve basım sanayi, fosil yakıt kullanıcıları vb. sektörlerdeki sanayiler doğal kaynakları yoğun olarak tüketirler (Welford, 2005: 23-24). Bu doğal kaynakların kullanımı sonucu işletmeler faaliyetlerini yürütmekte ancak çevreyi de olumsuz etkilemektedirler. Bu anlamda işletmelerin çevreye yönelik birtakım önlemler almaları gerekli olacaktır. İşletmeler, çevreyi koruma yönünde birtakım çalışmalara başladığı anda çevresel nitelikli

finansal veya finansal olmayan bilgilere de ihtiyaç duyacaklardır. Bu bilgiler işletme yönetimi tarafından, başta maliyet azaltımı olmak üzere, çevresel performans gelişimi, stratejik kararlar ve sosyal-etik etkiler açısından anlamlı bir hale getirilerek kullanılırlar. Buna paralel olarak işletmeler çevresel harcamaları detaylı olarak görebilecekleri raporlar oluşturmalıdır. Bu raporlar muhasebe sistemine entegre edilmiş değerlerden elde edilir ve günlük, haftalık, aylık veya yıllık olmak üzere işletme yönetiminin ihtiyacı doğrultusunda hazırlanabilir. Dolayısıyla durumunun yansıtılması ve sağlıklı çevresel denetimlerin kolaylaştırılması amacı çevre koruma maliyetlerine ilişkin bilgilerin muhasebeleştirilerek, hesap planında ve mali tablolarda ayrıca gösterilmesi ile mümkün olacaktır (Ergin ve Okutmuş, 2007: 156). Bu anlamda işletmelerin çevresel raporlama yapmaları rekabet üstünlüklerini arttırabilecektir.

Yatırımcıların işletmelerin sadece ekonomik durumuyla ilgilenmemesi sonucu sosyal raporlamanın öncelikli amacı yatırımcılara karar alma süreçlerinde ihtiyaç duydukları bilgileri sağlamaktır. Çünkü yatırımcılar işletmenin sadece ekonomik boyutuna bakmamaktadırlar. İşletmenin üretim sırasında çevreye verdiği zarar, çevreyi korumak için yaptığı yatırımlar, çalışanlarına sağladığı haklar vb. sosyal ve çevresel faktörler de yatırımcıların karar almasında önemli rol oynamaktadır (Angay, 2006: 35). Bunun yanında özellikle müşteriler işletmelerin katlandıkları çevresel maliyetleri hakkında bilgi sahibi olacaklardır. Çevresel faaliyetlerin raporlanması sonucu işletmeler aynı zamanda topluma paydaşlarına ve çevreye karşı olan sosyal sorumluluklarını da yerine getirmektedir.

Muhasebe bilgi sistemi, üretilen bilgilerin ilgili kişilere ve kuruluşlara sunan bir sistemdir. Tüm bu bilgi gereksinimi içerisinde ilgili kişilere verilecek bilgilerin yanında çevresel verileri de ekleyerek rapor şekilde sunulması gerekmektedir. Bu işlem sonucu işletmelerde çevre bilincinin yerleşmesi ve çevresel konularda duyarlılığın artmasıyla olabilecektir. Dolayısıyla işletmelerin yerine getirmek zorunda oldukları çevresel yükümlülüğü muhasebeleştirerek tüm bilgi ihtiyacı olan gruplara sunulmak amacıyla raporlanması gerekmektedir (Tuğlu, 2010: 67). İşletmeler çevresel faaliyetlerinde ne kadar maliyete katlandıklarını gelecekte çevre ile ilgili hangi faaliyetlerde bulunacaklarını çevre raporu ile topluma duyurmaktadırlar. Çevresel duyarlılığa sahip işletmeler hakkında bilgi sahibi olan toplum ilgili işletmelerin ürünlerine olan taleplerini arttırmaları beklenmektedir.

Finansal nitelikli çevresel bilgilerin muhasebe sistemi içine entegrasyonunda zaten bir sorun yoktur. Dolayısıyla çevresel bilgiler diğer muhasebe işlemleri ile birlikte kayıtlara alındıklarından muhasebenin nihai raporlarında yer alırlar. Ancak bunun yanında çevresel bilgilerin daha net görülebilmesi için ayrı raporlar da düzenlenebilir. Finansal nitelikli çevresel bilgilerin ayrıca raporlanabileceği çevresel maliyet raporları ilgi gruplarının işletmenin çevresel maliyetleri hakkında daha kolay bilgi edinebilmesini sağlayabilecektir. Dolayısıyla finansal nitelikli çevresel bilgiler ölçülerek kayıtlara alındıktan sonra işletmenin ilgi gruplarından özellikle işletme yönetimin kullanımına uygun biçim ve periyotlarda hazırlanabilir (Kırılıoğlu, Can, 1998: 145).

Muhasebe bilgi sistemi, örgütün planlamasına, gelişimine operasyonel ve finansal durumun iyileştirilmesine yönelik bilgi üretimini sağlamaktadır. Muhasebe bilgi sistemi tarafından üretilen bilgiler işletmenin finansal durumu hakkında tüm paydaşlar bilgi sahibi olmasından dolayı muhasebe bilgi sisteminde bilgi kalitesi önem arz etmektedir (Dinç, Abdioğlu, 2009: 166). Bilgi özellikle kaliteli bilgi, işletmelerin etkin olarak faaliyetlerini sürdürebilmeleri, rekabet avantajı sağlamaları ve doğru kararlar alabilmeleri için kritik bir öneme sahiptir. Muhasebe bilgi sistemlerinde üretilen bilginin işletmeler açısından artan önemi, bu sistemlerde nitelikli (kaliteli) bilginin üretilmesini zorunlu kılmaktadır rekabet avantajı yaratabilmesi için işletmeye özgü olması ve transferi, hareketi, elde edilebilmesi ve yayılması çok kolay olmamalıdır. Stratejik bilgiyi ortaya çıkarmanın ve transfer etmenin belki de tek yolu, bu bilgiye sahip olanlar ile yakın ve daha etkileşimli bir ilişki kurmak ve geliştirmekten geçmektedir (Barca, 2002: 519). Bu etkileşim çevresel maliyet raporlama ile pekiştirilecektir.

Bilgi yönetimi, "işletmelerin en iyi kararları alarak rekabet üstünlüğü yaratmaları için bilginin sistematik ve planlı bir şekilde oluşturulması, sürekli olarak yenilenmesi, depolanması, paylaşılması ve kullanılması" şeklinde tanımlanabilir. Bilgi yönetimi başarılı bir şekilde uygulayan işletmeler değişimlere hızlı bir şekilde uyum sağlayan ve rakiplerine göre rekabet avantajı elde edecektir (Uzun ve Durna, 2008: 35). Bilgi yönetimi; "organizasyondaki tüm bilgi türlerinin, değer üretmeye ve rekabet avantajı sağlamaya yönelik olarak, etkili biçimde kullanılması ve yönetilmesi ile ilgili faaliyetlerin tamamıdır" (Zaim, 2005: 81). Bilgi yönetiminin amacı; karar vermeyi, üretimi, kaynak aktarımını, rekabeti, sürekliliği, gelişimi isabetlendirmek ve hızlandırmak için bilginin işletme içinde dolaşımını sağlayarak işletme verimine katkı yapacak doğru kişilere en uygun biçimde ulaştırmaktır (Çapar, 2003: 422). Günümüzde çevrenin korunması ve duyarlılığın artması sonucu işletmeler paydaşlara, özellikle müşterilerine çevre ile yaptıkları faaliyetleri ve duyarlılıklarını çok iyi anlatmalıdırlar. Çevresel bilgi yönetimine önem veren ve büyük çaba sarf eden işletmeler rekabet üstünlüğünü elde edecektir.

Nonak (1998)'e göre, "Kesin olan tek şeyin belirsizlik olduğu bir ekonomide sürekli rekabet üstünlüğünün tek güvenilir kaynağı bilgidir. Piyasalar değiştiğinde, teknolojiler çoğaldığında, rakipler fazlaştığında ve ürünler neredeyse bir gecede eskidiğinde başarılı firmalar, istikrarlı biçimde yeni bilgi üretebilen, bu bilgiyi organizasyonun her yerine geniş ölçüde yayabilen ve yeni teknolojilerde ve ürünlerde hızla kullanabilen firmalardır" (Nonaka, 1998: 29-50). Bu bağlamda işletmelerin rekabetsel üstünlük elde etmesi ve bu üstünlüğünü sürdürmesi sahip olduğu bilgi, teknoloji ve becerileri doğrultusunda yaratabilecekleri temel yetenekleriyle mümkün olabilecektir.

4.REKABET AVANTAJI AÇISINDAN İŞLETMELERİN TEMEL YETENEĞİ ve ÇEVRESEL RAPORLAMA

Temel yetenek, işletmeyi diğerlerinden ayıran, rakipleri tarafından kolayca görülemeyen ve taklit edilemeyen, rekabet üstünlüğü sağlayan ve nihayet vizyonun gerçekleştirilmesinde vazgeçilmez bir

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

nitelik taşıyan ve kendisine has temel bir kabiliyet analizi yapılırken, üzerinde durulması gereken husus, belirli bir ürünü değil, o ürünün üretilmesini sağlayan bilgi ve kabiliyetlerdir (Dinçer, 1998: 211). Koçel'e göre temel yetenek, "bir işletmeyi başka işletmelerden ayıran, işletmenin vizyonunu gerçekleştirmesinde rol oynayan, rakipler tarafından kolayca taklit edilemeyen bilgi, beceri ve yeteneği ifade etmektedir" (Koçel, 1999: 298).

Bir işletmenin kaynakları ve yetenekleri, müşterilerinin gereksinimlerini karşılamak amacıyla ürün ve hizmet geliştirmek, üretmek ve sunmak için kullandığı bütün finansal, fiziksel, beşeri ve kurumsal varlıkları kapsamaktadır (Campell ve Kathleen, 2002: 20). Bir firmanın büyümesi ve varlığını sürdürmesi, rekabet avantajı sağlaması, gelecekte iyi bir gelişme potansiyeli elde etmesi kendine özgü ve değerli yeteneklerine ve bu yeteneklerini etkin bir şekilde yönetmesine bağlıdır (Erol, 2005).

Temel yetenek; temel beceri, ayırt edici yetenek, kabiliyet ve meta kabiliyeti gibi kavramlarla sıkça karşılaştırılmaktadır. Firmalara sorulduğunda yetenek, bir şeyleri yapma kabiliyeti olarak ifade edilir. Bu basit tanım çerçevesinde düşünüldüğünde, eğer firma müşteri değerini bir rekabet unsuru olarak rakiplerine göre daha fazla kullanabiliyorsa, bu unsur firma için sadece güçlü ya da yüksek yetenek anlamına gelir. Eğer firma, müşteri değerini kullanmada rakiplerine göre daha başarısızsa bu da yeteneksizliğini gösterir. Bu anlamda yetenek, sadece firmaların gerekli faaliyetleri nasıl iyi yapabileceğini tanımlama yoludur (Bourne, 2002).

İşletmelerinin orta ve uzun vadede sürdürülebilirliği büyük ölçüde firmaların rakiplerine kıyasla sahip oldukları yeteneklere bağlıdır. Bu yeteneklerden firmanın yönetim özellikleri, araştırma geliştirme faaliyetleri, yenilik kapasitesi gibi faktörleri sayılabilir. İşletmelerin rekabet üstünlüğünün sürdürülebilmesi için düşük fiyat, yüksek kalite, müşterinin hızla değişen gereksinimlerine uygun ürünlerin üretilmesi gibi faktörler açısından da büyük bir öneme sahiptir (Erdurur vd, 2012: 15). Günümüz işletmeleri buldukları yerel ve küresel pazarlarda oldukça yoğun bir rekabet ile karşı karşıyadır. İşletmelerin rekabet avantajını arttırmak için çevreye duyarlı üretim gerçekleştirme tüm paydaşların nezdinde rakiplerine göre stratejik bir rolü bulunmaktadır.

İşletmeler sahip oldukları temel yeteneklerini ve kaynaklarını kullanmada işletme yeteneklerini geliştirecek stratejiler oluşturmak ve bu stratejileri uygulamak zorundadırlar. Rekabetsel avantaj sağlayacak temel yeteneği ortaya çıkaracak stratejiler geliştirmelidir. (Schermerhorn, 2004). Bu noktada paydaşların memnuniyetine özellikle müşteri memnuniyetine yönelik çevreye duyarlı ürünler üretmek ve geliştirmek, işletmenin sahip olduğu temel yeteneklerini ve müşteriye sunmuş olduğu faydanın işletme değerinin yükselmesini sağlar.

Çevrenin korunmasının işletmelerin rekabet avantajı üzerine etkileri konusu yakın zamana kadar iş dünyası ve akademik çevrelerin pek ilgisini çekmemiştir. Sanayi Devrimi'nden bu yana giderek artan endüstriyel faaliyetlerin bir sonucu olarak ortaya çıkan çevresel etkiler ve 1990'lardan bu yana yaşanan

sayısız ekolojik kriz dünyada giderek artan bir küresel sorun haline gelmiştir. Bu olumsuz çevresel etkileri gidermek için son yıllarda yoğun bir şekilde düzeltici politikalar uygulanmaya başlanmıştır. Birçok uluslararası düzenlemeler, çevre koruma sözleşmeleri ve yükselen tüketici çevreciliği, dünya genelindeki endüstrileri, “çevresel sürdürülebilirlik” kavramını stratejik bir konu olarak görmeye zorlamıştır. Çevre sorunlarını ortadan kaldırmayı amaçlayan yeşil yönetim, yeşil pazarlama, yeşil üretim ve yeşil inovasyon gibi çevre yönetimi kavramları firmalar için rekabet avantajı sağlamak için de kullanılmaya başlanmıştır. Başta maliyet kaygıları nedeniyle tercih edilen kaçınma taktikleri yerine proaktif çevresel sürdürülebilirliğe geçiş, oluşan yeni pazar fırsatlarından daha fazla yararlanmak isteyen çok sayıda işletmede yer edinmeye başlamıştır (Eğin, vd 2018: 4).

Dünyada artan çevre duyarlılığın işletmeleri çevreye daha duyarlı ürün ve hizmet geliştirme konusunda önemli bir baskı oluşturmuştur. Geçmişte işletmeler fiyat, performans ve kalite standartlarını temel olarak ürün geliştirmekteydi. Gelecekte ise bu unsurlara çevreci rekabet koşulları eklenerek, şirketleri çevre konusunda daha rasyonel bir davranış göstermeye zorlayacaktır (Darabaris, 2008: 5).

5. İŞLETMELERİN REKABET GÜCÜNÜ ETKİLEYEN FAKTÖRLER

5.1. Maliyetler

Maliyeti dikkate alarak fiyatlandırma gerçek hayatta görülen uygulanması en kolay fiyatlandırma şeklidir. İşletmelerin fiyatlarını geniş ölçüde rakiplere ve uyguladıkları fiyatlarına bakarak belirlemesidir. Aradaki fark fazla olmamak kaydıyla, rekabet fiyatından biraz yüksek veya biraz düşük bir fiyat saptanabilir. Rekabete gücünü arttırmaya yönelik fiyatlandırmanın en önemli özelliği, işletmenin fiyat ile maliyet veya talep arasında değişmeyen bir ilişkiyi sürdürmeye çalışmasıdır (Mucuk, 2001: 139). Maliyetler, İşletmelerin üretim maliyetlerini azaltacak yöntemleri en iyi biçimde uygulamaları gerekmektedir. Azalan maliyetler, işletmelerin fiyat avantajı ile pazardaki konumlarını güçlü kılmaktadır (Coşar, 2008: 46). İşletmelerin rekabet üstünlüğü sağlamada kullandıkların en önemli faktörlerden biri fiyattır. Fiyat ile rekabet edebilmek için kaliteden ödün vermeden maliyetlerin düşürülmesi gerekmektedir. Çevresel raporlama yapan işletmelerin toplum ve diğer paydaşların gözündeki imajına olumlu katkılar sağlaması nedeniyle, bu işletmelerin daha kolay ve daha ucuz finansman bulabilecekleri varsayılmaktadır. Finansman maliyetlerinin düşürülmesi üretim maliyetlerini de düşürecek bu durumda, çevresel raporlama yapan işletmeler fiyatlar açısından dolaylı olarak rekabet üstünlüğü elde edebileceklerdir.

5.2. Yatırım Yapabilme Gücü

İşletmelerin rekabet ortamında karşı karşıya kaldığı sorunların büyük çoğunluğunun temelini finans oluşturmaktadır. Özellikle küçük ve orta ölçekli işletmelerin finans sıkıntısına bağlı olarak

yaşadığı temel sorunların aşılması için ülke yönetimlerinin teşvik politikalarını arttırmaları gerekmektedir. Yatırımlar için gerekli politik ve çevresel koşulların da uygun olup olmadığı işletmelerin rekabet gücünü önemli ölçüde etkilemektedir (Doğan ve Diğ. 2003: 116). Bazı ülkelerin koymuş olduğu uyulması zorunlu standartlar, kurallar nedeniyle dış ülkelere ihracat yaparak uluslararası şirketlerle rekabet etmek zor olmaktadır. Bununla birlikte çevresel raporlamayı yapan ve çevreye duyarlı ürünler ürettiğini paydaşlara anlatan işletmeler bu tür zorlukları ve formaliteleri daha rahat aşabilecektir. Ayrıca ülke yönetimleri ve düzenlemeleri çevreye duyarlı ürünlerin tüketilmesini teşvik ettikleri için çevresel duyarlılığa sahip işletmelerin bu ülkelere yatırım yapabilme imkânları daha fazla olacak bu da ilgili işletmelere rekabet avantajı sağlayabilecektir.

5.3. Kalite ve Standartlara Uygunluk

Dünyada küreselleşmenin etkisi ile işletmeler arasında oluşan yoğun rekabet ortamında başarılı olmak için işletmelerinin uygulanabilir hizmet kalite standartları geliştirmeleri ve uygulanmasını kontrol altına alması gereklidir (Zengin ve Bilgiçli, 2013: 4). Kalite kavramının önemli isimlerinden birisi olan Deming (1982) tarafından vurguladığı gibi, değişen müşteri istek ve beklentilerine karşılık verebilecek kalite anlayışı ve uygulamaların benimsendiği ve sürekliliğinin sağlandığı işletmeler, rakipleri karşısında üstünlüklerini koruyabilecek bir pozisyona sahip olabilirler. Özellikle uluslararası kalite standartlarına uygun ürün ya da hizmet üretimini gerçekleştiren işletmeler, iç pazarda olduğu gibi dış pazarda da rekabet avantajına sahip olacaklardır (Coşar,2008: 48). Günümüzde birçok ülke kendi sınırları içerisinde satılabilecek ürünler için çeşitli kalite standartları belirlemiştir (Doğan ve Diğerleri, 2003:118). Bu standartlarda üretimde çevreye zarar vermeyen hammaddelerin kullanılması şartı vardır. Çevresel raporlama ile katlanılan çevresel maliyetler, yapılan çevresel yatırımlar, kullanılan çevreye duyarlı hammadde maliyetleri açıklanacağı için kalite ve standartlara uygunlukta zorluklarla karşılaşılacağı düşünülmektedir. Bu durum çevresel raporlama yapan işletmelerin rekabet faktörlerinden olan kalite ve standartlara uygunluk faktörünü de rekabet avantajına dönüştürebilecektir

5.4. Güvenilirlik

Güvenilirlik, ürünün kullanım esnasında beklenen tüm fonksiyonları tam olarak yerine getirip getiremediğinin bir ölçüsüdür. Piyasa ortamında müşterilere sunulan ürünün güvenilirliği, müşteriler açısından bir tercih nedeni oluşturacaktır. Bu durumda ürün güvenilirliği yüksek olan işletmelerin rekabet gücünün de rakipleri karşısında yüksek olması doğal olarak kaçınılmazdır (Doğan ve Diğ. 2003: 116). Çevresel raporlama ile çevreye karşı duyarlı ürünler üretmek için katlanılan maliyetler ve çevreye duyarlı ürünler hakkında bilgilendirilen paydaşların ve özellikle müşterilerin ilgili şirkete ve ürünlerine güvenlerinin artacağı ortaya çıkmaktadır. Güvenilir işletmelerin ürünleri müşteriler tarafından daha fazla tercih edileceği için rekabet avantajı sağlayacaktır.

5.5. Teknoloji ve Ar-Ge

Küresel değişimlerin etkisiyle teknolojik yenilikler daha hızlı bir şekilde eskimekte veya dünyanın her hangi bir yerinde ortaya çıkan bir turizm uygulaması çok çabuk taklit edilebilmektedir. Bu nedenle işletmelerin rekabet üstünlüğü sağlayabilmelerinin bir koşulu da sürekli ihtiyaçları belirleyerek isteklere göre yeni ürün ve hizmetleri piyasaya sunmalarıdır. Bunun içinde hizmet işletmelerinin Ar-Ge çalışmalarına ayrılan payın artması veya en azından yeterli düzeyde olması gerekir. Ulusal ve uluslararası pazarlarda rekabet avantajı sağlamak ve bu avantajlarını sürekli kılmak isteyen işletmelerin rakiplerine göre daha kaliteli ürünü uygun teknolojiyi kullanan ekipmanları seçerek müşteriye önemsendiğini göstermesi gerekmektedir (Doğan ve Diğ. 2003: 116). Günümüzde teknolojinin çok hızlı bir şekilde gelişmiş ve gelişiyor olması, çevreye duyarlı ürünler üretebilme imkânlarını da ortaya çıkarmıştır. Çevreye duyarlı ürünlerin üretilmesi ve bu bilgilerin çevresel raporlama ile paylaşılması ilgili işletmeye rekabet avantajı sağlayabilecektir.

5.6. İşletme İmajı

Uluslararası pazarlarda olduğu gibi ulusal pazar anlayışında da alıcıların görmek istediği işletme imajı çok önemlidir. İşletmeler bu imaj çalışmalarını çeşitli tanıtım ve reklam faaliyetleri ile destekleyerek alıcıların ürün seçme davranışlarını etkilemek istemektedirler. Bu davranış etkisinin sonucunda satış ve rekabette üstünlük olarak sonuçlanabilecektir (Zengin ve Bilgiçli, 2013: 4). Tüketiciler satın alma faaliyetlerinde bulunmadan önce, işletme ile ilgili ipuçları ararlar. Tüketicilere sunulan hizmet kalitesi ile kurumsal imaj bu ipuçları arasında yer almaktadır. Hizmet kalitesi, birçok tanıma bakıldığında, müşterinin kendisine sunulan hizmetin genel olarak mükemmelliğini değerlendirmesi şeklinde ele alınmaktadır Hizmet kalitesi ile doğrudan ilişkisi bulunan müşteri tatmini kavramı; müşteri beklentileri ile gerçek deneyimi arasındaki uyum derecesi olarak ifade edilebilir (Coşar,2008: 49). Çevreye karşı sorumluluk, insan haklarına karşı duyarlılık gibi konular işletme imajı açısından büyük ağırlığa sahiptir (Doğan ve Diğerleri, 2003: 120). İşletmeler çevreye karşı ne ölçüde duyarlı olduklarını çevresel raporlama ile dış paydaşlara anlatabilecek ve bunun firma imajına olumlu katkılar sağlayarak, ilgili işletmenin rekabet gücünü arttırabilecektir.

5.7. Satış Sonrası Hizmetler

Günümüz pazarlama anlayışı geçmişte denenilen ve uygulanan pazarlama anlayışlarından farklıdır. Bu farklılık müşteri memnuniyeti odaklı bir satış, pazarlama anlayışı temelinde üretim yaparak, satışın gerçekleştirilmesinden sonra ürünün arkasında durmayı ve desteklemeyi gerektirmektedir. Satışın sonrasında hizmetin devamlılığı satışı kolaylaştırmanın yanında işletmelere rekabet gücü olarak artı değer katmaktadır. Satış sonrasında yeterli hizmetin verilmesi, şikayet yönetiminin doğru yapılması müşteri memnuniyetinin oluşturulması ve imajın zedelenmemesi önemli özelliklerden sayılabilir. Satış sonrası hizmet konusunda yukarıda sayılan özelliklere sahip olan, işletmelerin kaliteli çalışma ve rekabet üstünlüğüne ulaşma yönünde avantajlı olabileceği öngörülebilir (Zengin ve Bilgiçli, 2013: 4). İşletme

tarafından satılmış ürünlerin ömürleri sona erdiğinde hurda değeri üzerinden geri satın alınarak geri dönüşüme alınması, ilgili ürünün kullanım sonrası çevreye vereceği zararları ortadan kaldıracaktır. Satış sonrası bu şekilde hizmetleri sunan işletmeler bu durumu çevresel raporlama ile de paydaşlara açıklayabileceklerdir. Bu durumda satış sonrası hizmetlerin çevresel raporlama ile rekabet avantajına dönüştürülebilme imkânı ortaya çıkacaktır.

5.8. Strateji

Günümüzde rekabet avantajı yakalamanın etkili yöntemlerinden birisini de strateji oluşturmaktır (Hitt, Keats ve DeMarie 1998). Rekabete dayanan ekonomik bir ortamda strateji yeniliği, ilerlemeyi ve işletmelerin sürekli olarak çevreye uyumunu veya çevre ile karşılıklı uyum içinde olmasını sağlayarak, meydana gelen değişiklikleri kontrol altına alan yönetsel araç olmaktadır (Coşar, 2008: 50). Bu durum işletmeye sürdürülebilir rekabet avantajı sağlayacaktır.

6.SONUÇ VE ÖNERİLER

Çevre yalnızca insanların içinde yaşadığı ve hayatlarını devam ettirmeleri için kaynaklar sunan bir ortam değil, aynı zamanda tüm paydaşlar için ekonomik bir kaynak olduğu için, işletmelerin çevreye duyarlı olmaları ve çevreye duyarlı ürünler üretmesi tüm paydaşlar nezdinde işletmenin imajının artmasına olumlu katkı sağlayacaktır. Günümüzde hızlı gelişen dünya düzeni ile birlikte işletmelerin rekabet avantajı sağlayabilmesi çetin ve zor hale gelmiştir. Sanayileşme, teknolojik gelişmeler, hızlı nüfus artışı sonucunda ortaya çıkan sınırsız üretim anlayışı çevreye birtakım olumsuz durumlar çıkarmaktadır. Mal ve hizmet üretmek isteyen işletmelerin bu rekabet ortamında rekabet avantajı sağlayabilmesi için tüm paydaşların çıkarlarına özellikle müşterilerin beklentilerine uygun hareket etmesi ve ihtiyaçları karşılama zorunluluk hali almaktadır.

Literatür incelemesi sonucunda bu çalışmada bu çalışmamızda görülmektedir ki çevresel raporlama ile paydaşlara işletmenin katlanmış olduğu çevresel maliyetler, yatırımlar ve faaliyetler anlatıldığı zaman işletmenin temel yetenek kapsamında rekabet avantajı sağlayacaktır.

İşletmeler çevre ile ilgili yapmış oldukları yatırımları, maliyetleri ve faaliyetleri çevresel raporlama ile paydaşlara özellikle müşterilere bilgilendirmelerin sağlanması ve ikna etmesi durumunda, çevresel maliyetler işletmeler için dezavantajdan çıkıp rekabet avantajına dönüştüğü sonucuna ulaşmıştır.

Toplumların refah düzeylerinin artmasıyla çevreye duyarlı ürünler üreten çevresel beklentileri karşılayan çevresel faaliyetleri gerçekleştiren ve çevresel bilgilerin düzenlemesini çevre raporu ile topluma sunan işletmeler bu faaliyetleri yapmayan işletmelere göre rekabet avantajı sağlayacağı öngörülmektedir.

KAYNAKÇA

- Akgemci, T. (2013). "Stratejik Yönetim". (3.baskı). Ankara Gazi Kitap Evi.
- Altınbay, Ali. (2007). "Çevresel Maliyetlerin Raporlanması" Akademik Bakış Dergisi, S:11.
- Angay, Barış, (2006). "Halka Açık Şirketlerde Sosyal Raporlama ve Türkiye Uygulaması", Marmara Üniversitesi Bankacılık ve Sigortacılık Enstitüsü Sermaye Piyasası ve Borsa Anabilim Dalı Yayınlanmamış Yüksek Lisans Tezi, İstanbul.
- Ayrıçay, Yücel; Karataş Abdülmecit (Ed.), (2008) "Çevre Finansmanı: Muhasebe ve Finansman İçin Yeni Trendler", Ankara: Gazi Kitabevi, Eylül.
- Bahar, O. ve Kozak, M. (2012). "Turizm ve Rekabet". (1.baskı). Ankara Detay Yayıncılık.
- Barca, M. (2002). "Yeni Ekonomide Bilgi Yönetiminin Stratejik Önemi", 1. Ulusal Bilgi Ekonomi ve Yönetim Kongresi Bildiriler Kitabı, 10-11 Mayıs.
- Bourne, M. (2002), "Strategy and Performance: Competing Through Competence", Cambridge University Press, New York.
- Coşar, Yeşim, (2008), "Otel İşletmelerinde Rekabet Üstünlüğünü Etkileyen Faktörler: Yöneticiler Üzerine Bir Araştırma", Anatolia: Turizm Araştırmaları Dergisi, 19 (1): 45-56
- Campbell Andrew ve Sommers Luchs Kathleen, (2002) çev: Ezgi Sungur, Temel Yetenek Tabanlı Strateji, Epsilon Yayıncılık, 2002.
- Çapar, B. (2003). "Bilgi yönetimi: Nasıl bir insan gücü? "Tahir Büyük akın ve Figen Büyük akın (Yay. Haz.). II. Ulusal Bilgi, Ekonomi ve Yönetim Kongresi Bildiriler Kitabı içinde (ss. 421-432). İstanbul: Beta Basım Yayım.
- Darabaris, J. (2008). "Corporate Environmental Management", (<https://books.google.com.tr/books>).E.T: (24.11.2018)
- Dinç, Engin ve Abdioğlu, Hasan, (2009). "İşletmelerde Kurumsal Yönetim Anlayışı ve Muhasebe Bilgi Sistemi İlişkisi: İMKB-100 Şirketleri Üzerine Ampirik Bir Araştırma", Balıkesir Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi 12 (21), Haziran 2009
- Dinçer, Ö, (1998). "Stratejik Yönetim ve İşletme Politikası", Beta Yayınları, 1998, s.211.
- Doğan İpekgil Ö, Marangoz M, Topoyan M, (2003), "İşletmelerin İç ve Dış Pazarda Rekabet Gücünü Etkileyen Faktörler ve Bir Uygulama", Dokuz Eylül Üniversitesi Sosyal Bilimler dergisi Cilt 5, Sayı 2
- EğİN, E, Binboğa, G, ve Alaca, S. (2018). "Sürdürülebilir Rekabet Üstünlüğü Sağlamada Yeşil Temel Yeteneğinin Rolü". Manisa Celal Bayar Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 16(2), 1-20.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Erdurur K, Meriç S, Bozkurt Ö, (2012), "Yenilikçiliğin Rekabet Edilebilirlik Açısından Önemi; Akaçakoca Otel Örneği", XI Geleneksel Turizm Paneli 2012 Sakarya Üniversitesi
- Ergin, H. ve E. Okutmuş. 2007. "Çevre Muhasebesi: Çevre Maliyetleri ve Çevre Raporlanması", Yönetim Bilimleri Dergisi 5/1: 144–169.
- Evans G. (2002) "Measuring and Managing Customer Value", Work Study, 51(3): 134-139.
- Ekinci, H. (2006). "Bilgi Teknolojilerinin Rekabet Açısından Önemi ve Değişim Yönetimindeki Etkilerine İlişkin Yöneticilerin Algılarını Ölçmeye Yönelik Bir Araştırma". Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, (11): 54-70.
- Erol, Y, (2005). "Orta Karadeniz Bölgesindeki İşletmelerin İçsel Temel ve Destek Fonksiyonel Yeteneklerinin Analizi ve Performansa Etkileri", Gebze Yüksek Teknoloji Enstitüsü, Sosyal Bilimler Enstitüsü İşletme Bölümü Yayınlanmamış Doktora Tezi,
- Hitt, A. M., Keats, B. W. ve DeMarie, S. M. (1998). "Navigating in the New Competitive Landscape: Building Strategic Flexibility and Competitive Advantage in the 21th Century", Academy of Management Executive, 12(4):22-42.
- Gönel Feride ve Atabarut Tamer (2005), "Şirketlerin Yeni Yönetim Aracı: " Çevre Muhasebesi" Tusiad.
- Kırlioğlu, Hilmi. ve Can, Ahmet. (1998). "Çevre Muhasebesi " (1. Baskı). Adapazarı. Değişim yayınları.
- Koçel, (1999). "İşletme Yöneticiliği", 7.Basım Beta Yayım, İstanbul,1999: 298.
- Mucuk, İ.(2001). "Pazarlama İlkeleri", 13. Baskı, Türkmen Kitabevi , İstanbul
- Nonaka, I. (1998), "The Knowledge Creating Company", Harvard Business Review On s.157- 184 Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, 11(1): 20-56
- Okumuş, Fevzi, (2002). "Turistik İşletmelerde Rekabet Avantajı Yaratılma ve Korunma", T.C. Turizm Bakanlığı II. Turizm Şurası Bildirileri, Ankara,12-14 Nisan 2002.
- Özkaya, Betül. (2010). "İşletmelerin Sosyal Sorumluluk Anlayışının Uzantısı Olarak Yeşil Pazarlama Bağlamında Yeşil Reklamlar-Green Advertisements in the Context of Green Marketing As an Extension of the Social Responsibility Understanding of Companies" ,Öneri Dergisi, 9(34): 247-258.
- Pamukçu, Fatma, (2011), "Finansal Raporlama ile Kamuyu Aydınlatma ve Şeffaflıkta Kurumsal Yönetimin Önemi", Muhasebe ve Finansman Dergisi, Nisan
- Porter, M. E. (1985). "Creating and Sustaining Superior Performance New York: Free Press.
- R. Welford,(2005). "Corporate Environmental Reporting and Disclosure in China", (England: 2005), 23-24.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Schermerhorn, J.R. (2004). "Core Concepts of Management, John Wiley & Sons, Hoboken", New Jersey.

Taşdemir, Vahdi, (2011). "İşletme-Çevre İlişkilerinin Muhasebe Açısından Raporlanması", yüksek lisans tezi. Ankara Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü İşletme Anabilim dalı Muhasebe Finans Bilim dalı

Tekin, M., Ömürbek, N., (2004). "Küresel Rekabet Ortamında Teknolojik İşbirliği ve Otomotiv Sektörü Uygulamaları", Ankara. Selçuk Üniversitesi Yayınları

Tokgöz, Nuray, ve Önce, Saime. (2009). "Şirket Sürdürülebilirliği: Geleneksel yönetim Anlayışına Alternatif". Afyon Kocatepe Üniversitesi, İ.İ.B.F. Dergisi (C.X I,S I, 2009)

Tuğlu, Umut.(2010). "Çevre muhasebesi ve Alanya'daki bir konaklama işletmesinde uygulanması" yüksek lisans tezi. Turizm ve işletmeciliği ve otelcilik Anabilim dalı Antalya

Uluslan, Hikmet (2009). "Çevresel Raporlama Rehberi ve Çevresel Raporlarında Açıklaması Gereken Bilgiler", Süleyman Demirel Üniversitesi İ.İ.B. F. Dergisi.

Uzun, H, ve Durna, U. (2008). "İşletmelerde Rekabet Unsuru Olarak Bilgi Yönetimi". Niğde Üniversitesi İİBF Dergisi, Haziran 2008, 1 (1): 33-40.

Yağlı Fatma (2006) "Çevre Muhasebesi ve Mermer İşletmeleri Uygulaması" , Muğla Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, Yayınlanmamış Yüksek Lisans Tezi, Muğla.

Zengin B, ve Bilgiçli Ö.(2013). "Turizm İşletmelerinde Rekabet ve Rekabet Gücünü Etkileyen Unsurlar Üzerine Kavramsal Bir İnceleme" 17. Ulusal Turizm Kongresi" Akademik Sektör Buluşması" Detay Yayınları

Zaim, H. (2005). "Bilginin Artan Önemi ve Bilgi Yönetimi", İşaret Yayınları, İstanbul.

[http://www.iktisadi.org&oq=www.iktisadi.org&aqs=chrome..&sourceid=chrome&ie.e.t:\(24.11.2018\)](http://www.iktisadi.org&oq=www.iktisadi.org&aqs=chrome..&sourceid=chrome&ie.e.t:(24.11.2018))

www.iktisadi.org.<http://www.yonetselzihin.com/stratejik-yonetim/rekabet-etmede-isletmeler-icin-stratejiler/.html>. e.t: (26.11.2018).

**VADESİNDE ÖDENEMEYEN BORÇLARIN SERMAYE OLARAK GÖSTERİLEREK
KREDİ DEĞERLİLİĞİNİN ETKİLENMESİNE DÖNÜK BİR UYGULAMA**

Dr. Öğr. Üyesi Muzaffer ŞAHİN¹⁹

ÖZET

Bu araştırma ile bir kamu bankasına kredi başvurusunda bulunan bir firmanın, gerçek finansal tabloları analiz edilecektir. Araştırmamıza konu edilen firmanın verileri ve yapılan işlemler tamamen gerçek bir uygulamadan alınmış olup, kesinlikle kurgulanmamıştır. Yapılan analiz ve değerlendirmelerle firmanın, kredi değerliliğini etkileyerek, kredi başvurusunun kabul görmesi ve talep edilen krediyi alabilmek adına, özkaynaklar hesap grubunda kredi değerliliğini etkilemek için, yapmış olduğu muhasebe işlemleri analiz edilerek değerlendirilecektir.

Yapılan bir dizi işlemler sonucunda, gerçekte vadesinde ödenemeyen borçların ticari faaliyeti olmayan bir kardeş kuruluşa aktararak, karşılığında alınan senetlerle aynı sermaye artışı yapılmak suretiyle, ödenmiş sermaye olarak gösterildiği, söz konusu borca ilişkin kur farkı, faiz ve komisyonların finansal tablolardan arındırılarak karlılığın yükseltildiği, böylece firma kredibilitesinin olduğundan çok daha iyi gösterildiğine ilişkin gerçek bir firma uygulaması ortaya konularak değerlendirilecektir

Anahtar Kelimeler ; Kredi Değerliliği, Bilanço Makyajı, Özkaynak, Sermaye, Ödenemeyen Krediler

JEL Sınıflandırması: M31, M40, M41, M42, M49

**A RETURN APPLICATION TO AFFECT CREDIT VALUE AS A CAPITAL AS THE
PAYABLE DEBT**

ABSTRACT

With this research, the real financial statements of a firm applying for a loan to a public bank will be analyzed. The data of the company and the transactions made in our research were taken from a real application and it is not strictly constructed. By analyzing and evaluating the creditworthiness of the firm, the credit application will be accepted and the accounting transactions made to affect the credit worthiness in the shareholders' equity account group will be analyzed and evaluated in order to obtain the loan requested.

As a result of a series of transactions, it is stated that the debts, which cannot be paid on maturity, are transferred to a non-commercial company and paid in cash with the same capital as the paid capital. exchange rate, interest and commissions are eliminated from financial statements and profitability is

¹⁹ Çankaya/Ankara-Türkiye, dr.muzaffersahin@gmail.com

increased, Thus, the firm credibility of the firm is shown to be much better than the real firm application will be evaluated and evaluated.

Keywords ; *Credit Valuation, Balance Sheet Makeup, Equity, Capital, Unpaid Loans*

JEL Classification: *M31, M40, M41, M42, M49*

1. GİRİŞ

Öz kaynaklar, İşletme sahip veya ortaklarının bilanço tarihinde işletmeye yapmış oldukları sermaye yatırımlarının tutarını, sermaye ve kar yedeklerini, geçmiş yıllar ve döneme ilişkin kar ve zarar tutarını göstermekte olup, işletmelere borç veren banka ve piyasa aktörlerinin kararlarını oluşturmada en çok dikkate aldıkları hesap grubunu oluşturmaktadır.

Öz kaynakları, buna bağlı olarak mali yapıları güçlü olan işletmeler, daha az risk taşımaları nedeniyle, kreditor kurumların kredi vermek için en çok rağbet ettikleri firmalar grubunu oluşturmaktadır.

Yüksek öz kaynağa sahip olan firmaların borç ödeme yetenekleri de daha yüksek olacağından, kredi raiting notları yüksek seviyelerde gerçekleşmektedir. Firmaların kredi raiting notunun yüksek olması ise, vadesi, teminat koşulları ve faiz oranları bakımından, gerek yurt içinden gerekse yurt dışından daha uygun koşullarda kredi bulma imkanını yaratmaktadır. Bu nedenle, banka ve finans kurumları ile üçüncü kişilerin kredi kararlarını olumlu etkilemek isteyen bazı firmalar öz kaynaklar hesap grubu içerisinde yapılan bazı muhasebe işlemleriyle, mali yapılarını olduğundan çok daha iyi gösterebilmektedirler.

Bazı firmalar kredi değerliliğini olduğundan çok daha iyi göstermek için bu yönde muhasebe işlemlerine başvurarak, banka ve finans kurumlarının yanılmalarına, böylece hak edilmeyen koşul ve tutarlardaki kredilerin hak edilmeyen firmalara verilmesi sonucu çıkabilmektedir. Bu durum kredilerin seyyaliyeti prensibini ortadan kaldırarak, kredilerin vadesinde tahsil edilememesine, tahsili gecikmiş, donuk alacakların artmasına, bankalar ve ülkemiz için kaynak kaybına neden olabilmektedir. Bu çalışmayla, ilgili tarafların özellikle banka ve finans kuruluşları ile vadeli satış veya borç veren üçüncü şahısların bilgilendirilmesi başlıca amacımızı oluşturmaktadır.

2. ÖZ KAYNAKLAR HESAP GRUBUNDA BULUNAN HESAPLARIN TANIMI

2.1. Öz Kaynakların Tanımı

İşletmeler faaliyetlerini sürdürebilmek ve yatırım yapabilmek için gereksinim duydukları kaynakları iki finansman türü ile karşılarlar. Birinci tür finansman kaynağını, uzun ve kısa vadeli finansman olarak kreditorlerden ve diğer işletmelerden sağlarken; ikinci tür finansman kaynağını yatırımcılardan başka bir deyişle işletmenin sahip ve ortaklarından sağlar (Mugan ve Akman, 2010:524). İşletmenin sahip ve

ortaklarından sağlanan finansmana ilişkin olan ve varlıkları finanse etmekte kullanılan, bir başka deyişle, işletme varlıkları üzerinde işletme sahiplerinin talep haklarını ifade eden kaynaklara, “öz kaynaklar” denir (Beyazıtılı, Çelik ve Gürdal,2015:647). Öz kaynaklar, öz sermaye veya öz varlıklar kavramı ile de ifade edilmektedir (Küçüksavaş, 1998:329). Bir işletme kuruluşta veya kuruluştan sonra, hukuki yapısına göre yeni ortaklar alarak veya pay senedi çıkarma yoluyla öz sermayesini artırabileceği gibi, elde edilmiş karlardan ayırdığı yedekleri ve dağıtılmayan karları, faaliyetlerinin finansmanında kullanarak (oto-finansman yoluyla) da öz sermayesini güçlendirebilir (Akgüç,1998:753).

Öz kaynaklar (öz sermaye), hukuki yapıları ne olursa olsun, yeni kurulan işletmeler için ilk fon kaynağını oluşturduğu gibi, mevcut işletmelerin borçlanarak kaynak bulmalarına olanak sağlar. Hiçbir işletme sermaye tabanına dayanmadan, sürekli olarak borçlanma yoluyla kaynak sağlayamaz. Öz sermaye ise, işletmeler açısından sürekli bir kaynak niteliğindedir (Akgüç,1998:753).

“Öz kaynaklar”, “öz sermaye”, “öz varlık” veya “iş sahiplerinin sermaye payları”, “sermaye”, “mal sahipliği” gibi aynı anlamda kullanılan kavramlar; toplam aktifler ve toplam pasifler arasındaki farkı ifade eder (Holmes, Owermyer: 2004:380). Bu kavramlar işletme sahiplerinin varlığı olan toplam aktifler ile borçlar arasındaki varlığını gösterir (Weygandt, Kieso, Kimmel, 2005:12).

Görüldüğü üzere, bilanço bir işletmenin varlıklarını gösterirken, bu varlıkları elde edebilmek için gerekli kaynakların sağlandığı hak sahiplerini de göstermektedir. Bu nedenle bilançolar düzenlenirken, hak sahipleri ile ilgili yukarıda belirtilen “Kısa Vadeli Borçlar “ kavramı, “Kısa Vadeli Kaynaklar”, “Uzun Vadeli Borçlar” kavramı “Uzun Vadeli Kaynaklar“ ve “Öz Sermaye” kavramı da “Öz Kaynaklar” şeklinde kullanılır (Pekdemir,1994:19).

2.2. Öz Kaynakların Kapsamı;

Öz kaynaklar, işletmenin varlıklarından borçlar düşüldükten sonra geriye kalandır (Walton, Aerts, 2009:192). Öz Kaynaklar, İşletme sahip veya ortaklarının bilanço tarihinde işletmeye yapmış oldukları sermaye yatırımlarının tutarını gösteren ödenmiş sermaye ile, Sermaye Yedekleri, Kar Yedekleri, Geçmiş Yıllar Karları ve Geçmiş Yıllar Zararları ve Dönemin Net Kar veya Zararını kapsar.

Öz kaynaklar, işletme sahip veya ortaklarının bilanço tarihinde işletmeye yapmış oldukları sermaye yatırımlarının tutarını gösteren ödenmiş sermayeden, sermaye yedeklerinden, kar yedeklerinden, geçmiş yıllar karlarından ve geçmiş yıllar zararlarından ile dönemin net kar ve zararından oluşmaktadır (Sürmen, 2005:222). Sermaye işletme sahip veya ortaklarının, işletmenin varlıkları üzerindeki haklarının parasal ifadesidir (Sürmen, 2005:212). Bu durum aynı zamanda işletmenin varlığını da ortaya koyar. Bir işletmenin varlığı alacaklılardan sağlanan borç ve işletme sahiplerinden karşılanan sermaye ile sağlanır. Nitekim tasfiye söz konusu olduğunda, varlıklar elden çıkarıldığında borçlar ödendikten sonra işletme sahiplerine ödeme yapılabilir (Weygandt, Kieso, Kimmel, 2005:12).

Öz kaynaklar, klasik muhasebe öğretisinin temel eşitliği olarak, şirketlerin sahip oldukları net varlıktır (Gül, 2013:213).

V.U.K.'un 175 ve mükerrer 257. Maddelerine dayanılarak Maliye Bakanlığı tarafından yayınlanan "Muhasebe Sistemi Uygulama Tebliği'nde; öz kaynaklar, "İşletme sahip veya ortaklarının bilanço tarihinde, işletmeye yapmış oldukları sermaye yatırımlarının tutarını gösteren, ödenmiş sermaye ile sermaye yedekleri, kar yedekleri, geçmiş yıllar zararları ve dönemin net karını veya zararını kapsar" şeklinde açıklanmıştır. Buna göre öz kaynaklar aşağıda belirtilen bilanço hesapları kapsamındaki 4 grup başlığı altında sınıflandırılan kalemlerinden oluşmaktadır (Özer,1997:30).

- a) Ödenmiş Sermaye (Sermaye hesabı ile pasif düzenleyici nitelikteki ödenmemiş sermaye hesabından oluşmaktadır. Bu iki hesap arasındaki fark ödenmiş sermayeyi oluşturur.)
- b) Sermaye Yedekleri (Hisse senedi ihraç primleri, hisse senedi iptal karları, maddi duran varlık yeniden değerlendirme artışları, iştirakler yeniden değerlendirme artışları ve diğer sermaye yedekleri.)
- c) Kar Yedekleri (Yasal yedekle, statü yedekleri, olağanüstü yedekler, diğer yedekler ve özel fonlar.)
- d) Kar ve Zarar hesapları (Geçmiş yıllar ve cari döneme ait hesaplardan oluşmaktadır.)

2.3. Öz Kaynaklar Grubunda Yer Alan Hesapların Tanımı;

2.3.1. 500- Sermaye;

İşletmelerin birer tüzel kişilik olarak hukuksal varlıklarını kazanmaları için gerekli unsurlardan biri de sermayedir (Gül,2013:212). İşletmeye tahsis edilen veya işletmelerin ana sözleşmelerinde yer alan ve Ticaret Siciline tescil edilmiş bulunan nominal sermaye tutarı (Akdoğan, Tenker:1992:80) olup, bu hesapta yer alır. Kayıtlı sermaye sistemine alınan ortaklıklarda çıkarılmış sermaye gösterilir. Kayıtlı sermaye tavanı ayrıca dipnotlarda belirtilir. Taahhüt edilen sermaye tutarı bu hesaba alacak, ödenmemiş sermaye hesabına borç kaydedilir.

Sermaye işletme sahip veya ortaklarının, işletmenin varlıkları üzerindeki haklarının parasal ifadesidir (Sürmen,2010:222).

2.3.2. 501- Ödenmemiş Sermaye (-);

İşletmeye tahsis edilen veya ortaklarca yüklenilen sermayenin henüz ödenmemiş kısmıdır.

2.3.3. 52- Sermaye Yedekleri;

Hisse senedi ihraç primleri, iptal edilen ortaklık payları ve yeniden değerlendirme değer artışları gibi "sermaye hareketleri dolayısıyla ortaya çıkan ve işletmede bırakılan tutarların" (Akdoğan, Tenker:1992:80) izlendiği hesap grubudur. Ticaret kanunu hükümleri, ortaklar genel kuruluna geniş yetki vermiştir. İşletmelerin ortaklar kurulu dönem karını hiç dağıtmayarak ya da az dağıtarak yedek

akçelerini artırmak suretiyle öz kaynaklarını artırma olanağına sahiptir (Karayalçın,1998:96). Yedek akçeler çeşitli amaçlar için işletmenin net karından ayrılmış, ortaklara dağıtılmamış, başka deyimle birikmiş kardır. Yedekler (dağıtılmayan karlar) işletmenin faaliyetleri sırasında çeşitli şekillerde oluşan ve ortaklara dağıtılmayıp işletmede bırakılan veya henüz dağıtım konusu yapılmamış olan değer artışlarından ve karlardan oluşur. Yedekler genellikle işletmenin sürekliliğini ve gelişmesini sağlamak, alacaklıların haklarını korumak, iş hayatındaki belirsizliklerden kaynaklanan riskleri azaltmak, gelecekteki olası zararları karşılamak, kar dağıtımında istikrar sağlamak ve iş hacminin gelişmesi nedeniyle artacak işletme sermayesi ihtiyacını karşılamak gibi nedenlerle ayrılır.

2.3.4. 520- Hisse Senedi İhraç Primleri;

Yeni çıkarılan hisse senetlerinin primli satışından kaynaklanan tutarlar (Akdoğan, Tenker 1992:81) bu hesapta izlenir. Hisse senedinin nominal fiyatı ile satış fiyatı arasındaki fark bu hesabın alacağına satış biçimine bağlı olarak ilgili hesabın borcuna kaydedilir. Bu tutarların sermayeye ilavesi veya başka bir amaçla kullanılması durumunda hesaba borç kaydedilir.

2.3.5. 521- Hisse Senedi İptal Karları;

İptal edilen hisse senetlerinin bedellerine mahsuben yapılan ödemelerin, bunların yerine çıkarılan hisse senetlerinden elde edilen hasılat noksanı kapatıldıktan sonra artan kısmın (Akdoğan, Tenker 1992:81) izlendiği hesaptır.

2.3.6. 522- M.D.V. Yeniden Değerleme Artışları;

İşletmenin aktifine kayıtlı maddi duran varlık kalemlerinin yeniden değerlendirilmesinden oluşan değer artışlarının izlendiği hesaptır. Yeniden değerlendirme net değer artışı ilgili hesaplar karşılığında bu hesaba alacak kaydedilir. Bu tutarların sermayeye ilavesi veya başka bir amaçla kullanılması durumunda bu hesaba borç kaydedilir.

2.3.7. 523- İştirakler Yeniden Değerleme Artışları;

İşletmenin iştirakleri ile bağlı ortaklıkları bünyesinde yapılan yeniden değerlendirme dolayısıyla oluşan değer artışının sermayeye eklenmesi sonucunda, bu sermayeden işletmeye isabet eden kısmı gösterir.

2.3.8. 529- Diğer Sermaye Yedekleri;

Bu hesap grubu içerisinde sayılanların dışında kalan diğer sermaye yedekleri izlenmektedir.

2.3.9. 54- Kar Yedekleri;

Kanun, ana sözleşme hükümleri yada ortaklıkların yetkili organları tarafından alınan kararlar uyarınca, dağıtılmamış ya da işletmede alıkonulmuş karlar bu hesap grubunda gösterilir.

2.3.10. 540- Yasal Yedekler;

Kanun hükümleri uyarınca ayrılmış bulunan yedekler bu hesap kaleminde gösterilir.

2.3.11. 541- Statü Yedekleri;

Ana sözleşme hükümleri çerçevesinde ayrılan yedekler bu hesap kalemi içinde yer alır.

2.3.12. 542- Olağanüstü Yedekler;

Sermaye şirketlerinde Genel Kurul tarafından ayrılmasına karar verilen olağanüstü yedek akçeler ile dağıtım dışı kalan karlar bu hesapta yer alır.

2.3.13. 548- Diğer Kar Yedekleri;

Özellikle kendi bölümlerinde tanımlanmamış olan kardan ayrılan diğer yedekler izlenir.

2.3.14. 549- Özel Fonlar;

İşletmede bırakılması ve tasarrufu zorunlu yasal fonlar ile diğer maksatlarla ayrılan fonlar izlenir.

2.3.15. 570- Geçmiş Yıllar Karları;

Geçmiş faaliyet dönemlerinde ortaya çıkan ve işletme sahibine veya ortaklarına dağıtılmamış bulunan karlardan ilgili yedek hesaplarına alınmayan tutarların izlendiği hesaptır.

2.3.16 580- Geçmiş Yıllar Zararları;

Geçmiş faaliyet dönemlerinde ortaya çıkan dönem net zararlarının izlendiği hesaptır.

2.3.17. 59- Dönem Net Karı(Zararı);

Bu grup işletmenin nihai faaliyet sonucunu gösteren hesapları kapsar.

2.3.18. 590- Dönem Net Karı;

İşletmenin faaliyet dönemine ilişkin vergi sonrası net kar tutarının izlendiği hesaptır.

2.3.19. 591- Dönem Net Zararı (-);

İşletmenin faaliyet dönemine ilişkin net zarar tutarının izlendiği hesaptır. Sonuç hesaplarında yer alan "692- Dönem Net Karı veya Zararı Hesabı"ndan aktarılan tutarlar bu hesaba borç, aynı hesaba alacak kaydedilir.

3. KREDİ DEĞERLİLİĞİNİN BELİRLENMESİNDE ÖZ KAYNAKLARIN ÖNEMİ

Öz kaynaklar işletme sahip veya ortaklarının bilanço tarihinde işletmeye yapmış oldukları yatırımları göstermesi nedeniyle kredi değerliliğinin belirlenmesinde en çok önem verilen kalemlerden birisidir. Bunun başlıca nedenleri aşağıda belirtilmiştir;

- Gerçekleştirilmiş veya gerçekleştirilmekte olan yatırımlarda öz kaynak kullanım oranının yüksek olması ve uygun koşullardaki yabancı kaynak kullanımı, yatırımların geri dönüş süresini azaltarak yatırımların verimliliğini arttırıcı etki yapmaktadır.

- Öz kaynakları, buna bağlı olarak mali yapıları güçlü olan işletmeler daha az risk taşımaları nedeniyle kreditor kurumların kredi vermek için en çok rağbet ettikleri firmaları oluşturur. Söz konusu işletmeler kreditor kurumların bu eğiliminden yararlanarak en uygun koşullarda kredi kullanma olanağına sahiptir.

Yukarıda belirtilen nedenlerle güçlü öz kaynaklara sahip olan firmaların kreditor kurumlar karşısında daha avantajlı duruma geçerek kredi tutarı ve koşulları bakımından pazarlık yapma avantajını elde etmede öz kaynakların en büyük faktörlerden birisi olması, kredi değerliliğini etkilemek isteyen firmaların bu yönde değişik işlemlere yer verdikleri görülmektedir. Söz konusu uygulamalardan kanımızca en önemli olanı sermaye artışının borçlarla yapılmasıdır.

Aynı ortakların sevk ve idaresinde olan ve birden çok firmadan oluşan grup firmaları incelendiğinde, genellikle grubun varlık ve faaliyetlerinin belli firmalarda yoğunluk kazandığı görülmektedir. Varlık ve faaliyetlerin yoğunluk kazandığı mali yapısı daha güçlü olan firmalar piyasadan ve bankalardan kolaylıkla kredi temin edebilmekte ve bu firmaların sağladığı yabancı kaynaklar veya borçlanılarak alınan mal veya hizmetler grubun diğer firmalarına aktarılabilir. Söz konusu firmaların gerek bankalardan sağladığı krediler, gerekse piyasaya yapılan borçlar bağlı bulunan diğer grup firmalarına veya ağırlıklı hisse sahibi olan ortaklara devredilerek karşılığında uzun vadeli senetler alınmakta ve alınan senetler sermaye artışında kullanılabilir (Şahin,1998:300).

4. BORÇLARIN KARDEŞ KURULUŞLARA AKTARILMASI

Aynı kişi veya şirketlerin sevk ve idaresinde olan ve aynı gruba ait kredi değerliliği yüksek olan bazı firmaların borçlarını grubun diğer firmalarına devrederek mevcut kredi değerliliğini etkilemeye çalıştıkları uygulamada görülmektedir. Yönetimin aynı kişi veya şirketlere ait olması durumunda, grup firmaları arasında yoğun bir finansman ilişkisi bulunmakta, gerek banka kredileri, gerekse ticari veya diğer nitelikli borçlar grubun diğer firmalarına aktarılabilir.

X Sağlık Hizmetleri San ve Tic.A.Ş. firması, sağlık ve laboratuvar hizmeti vermek üzere 2004 yılında faaliyete geçmiştir. Söz konusu firma ile birlikte aynı kişi ve kurumların yönetiminde altı adet çeşitli konularda faaliyette bulunan firmalar X Holding A.Ş. bünyesinde yer almaktadır. Grubun mali yapısı en büyük olanı örneğimize konu firma olup, gruba bağlı diğer firmaların kayda değer bir faaliyeti bulunmamaktadır. X Sağlık Hizmetleri San.ve Tic. A.Ş. firmasının 31.10.2015 ve 31.12.2015 tarihli Bilanço ve Gelir Tabloları aşağıda verilmiştir;

| BİLANÇO | | | (\$) |
|-----------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| AKTİF | 31,10,2015 | 31,12,2015 | |
| I-DÖNEN VARLIKLAR | 4.564.745 | 5.826.524 | |
| A-Hazır Değerler | 1.504.192 | 900.513 | |
| 1-Kasa | 513.172 | 29.284 | |
| 2-Alınan Çekler | 94.857 | 386.920 | |
| 3-Banka | 1.142.940 | 963.146 | |
| 4-Verilen Çek.ve Öd.Em.- | - 247.982 | - 480.042 | |
| 5-Diğer Hazır Değerler | 1.205 | 1.205 | |
| B-Menkul Kıymetler | | 2.083.333 | |
| 1-Hisse Senetleri | | 857.843 | |
| 2-Özel Kes.Tah.Sen.Bon. | | | |
| 3-Kamu Kes.Tah.Sen.Bn. | | 1.225.490 | |
| 4-Diğer menk Kıymetler | | | |
| 5-Menk Kıym.Değ.Düş.K | | | |
| C-Ticari | 1.278.324 | 1.864.865 | |
| Alacaklar | | | |
| 1-Alicılr | 788.974 | 1.513.427 | |
| 2-Alacak Senetleri | 81.230 | 258.989 | |
| 4-Kred Kartlarından Alac. | 7.563 | 85.414 | |
| 5-Verilen Depozito ve T. | 2.805 | 2.806 | |
| 6-Diğer Ticari Alacaklar | 395.580 | 2.021 | |
| 7-Şüpheli Ticari Alacaklar | 2.172 | 2.208 | |
| D-Diğer Alacaklar | 1.026.987 | 1.920 | |
| 1-Ortaklardan Alacaklar | 1.026.987 | - | |
| 4-Personelden Alacaklar | | 1.920 | |
| E-Stoklar | 517.254 | 843.936 | |
| 4- Ticari Mallar | 520.442 | 845.239 | |
| 5- Diğer Stoklar | - 4.680 | - 2.795 | |
| 7-Verilen Sipariş Avansları | 1.492 | 1.492 | |
| H-Diğer Dönen Varlıklar | 237.988 | 131.957 | |
| 1-İndirilecek KDV | 123.625 | 120.759 | |
| 5-İş Avansları | 114.363 | 11.198 | |
| II-DURAN VARLIKLAR | 6.125.379 | 5.451.909 | |
| C-MALİ DURAN VARL. | 1.959.850 | 1.959.850 | |
| 3-İştirakler | 9.973 | 9.973 | |
| 6-Bağlı Ortaklıklar | 1.949.877 | 1.949.877 | |
| D-MADDİ DURAN VARL. | 3.730.228 | 3.425.855 | |
| 4-Tesis Mak. ve Cihazlar | 102.442 | 78.389 | |
| 5-Taşıtlar | 32.018 | 61.431 | |
| 6-Demirbaşlar | 613.817 | 661.340 | |
| 8-Birikmiş Amortismanlar- | - 146.217 | - 165.335 | |
| 9-Yapılmakta Olan Yat. | 3.128.168 | 2.790.030 | |
| E-MADDİ OLM.DUR VAR. | 376.843 | 20.544 | |
| 5-Özel Maliyetler | 32.677 | 20.544 | |
| 6-Diğ.Maddi Olm.Dur.Var. | 344.166 | - | |
| G-GEL.YIL.AİT GID.GEL.TH | 12.799 | - | |
| 1-Gel.Yıllara Ait Giderler | 12.799 | - | |
| H-DİĞER DURAN VAR. | 45.659 | 45.659 | |
| 1-Gel. Yıl.İnd.KDV. | 45.659 | 45.659 | |
| AKTİFLER TOPLAMI | 10.690.124 | 11.278.433 | |
| | 681 | | |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| PASİF | 31,10,2015 | 31,12,2015 |
|--------------------------------|-------------------|-------------------|
| I-KV YABANCI KAYNAKLAR | 7.172.152 | 2.285.983 |
| A-MALİ BORÇLAR | - | 51.647 |
| 1-Banka Kredileri | - | 51.647 |
| B-TİCARİ BORÇLAR | 4.682.000 | 1.065.756 |
| 1-Satıcılar | 1.335.070 | 1.065.756 |
| 2-Borç Senetleri | 3.346.931 | - |
| C-DİĞER BORÇLAR | 1.745.767 | - |
| 1-Ortaklara Borçlar | 1.745.767 | - |
| D-ALINAN AVANSLAR | 1.300 | 408.089 |
| 1-Alınan Sipariş Avansları | 1.300 | 407.771 |
| 2-Alınan Diğer Avanslar | - | 318 |
| F-ÖDEN. VER. VE DİĞ. YÜK. | 253.951 | 246.220 |
| 1-Ödenecek Vergi ve Fonlar | 150.834 | 176.656 |
| 2-Ödenecek Sos.Güv.Kes. | 103.117 | 69.564 |
| H-GELECEK AYLARA AİT GEL | 245.837 | 222.278 |
| 2-Gider Tahakkukları | 245.837 | 222.278 |
| J-DİĞER K.V. YAB.KAY. | 243.295 | 291.994 |
| 1-Hesaplanan KDV. | 243.295 | 291.994 |
| II-UZUN VADELİ YAB.KAY. | 1.966.929 | 23.762 |
| B-TİCARİ BORÇLAR | 1.943.262 | - |
| 2-Borç Senetleri | 1.943.262 | - |
| E-BORÇ VE GİD.KARŞ. | 23.667 | 23.762 |
| 1-Kıdem Taz.Karş. | 23.667 | 23.762 |
| III-ÖZKAYNAKLAR | 1.551.043 | 8.968.688 |
| A-ÖDENMİŞ SERMAYE | 1.475.490 | 6.468.137 |
| 1-Sermaye | 1.475.490 | 6.468.137 |
| B-SERMAYE YEDEKLERİ | 56.450 | 56.448 |
| 3-M.D.V.Yend.Değ.Artışları | 56.450 | 56.448 |
| E-GEÇMİŞ YIL ZARARLARI(-) | - 887.727 | - 887.728 |
| F-DÖNEM NET KARI(ZARARI) | 906.830 | 3.331.831 |
| 1-Dönem Net Karı | 906.830 | 3.331.831 |
| 2-Dönem Net Zararı | - | - |
| PASİFLER TOPLAMI | 10.690.124 | 11.278.433 |

| GELİR TABLOSU | | (\$) |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| DÖNEM | 31,10,2015 | 31,12,2015 |
| A-BRÜT SATIŞLAR | 12.162.296 | 15.540.494 |
| 1-Yurt İçi Satışlar | 12.148.313 | 15.526.511 |
| 3-Diğer Gelirler | 13.983 | 13.983 |
| B-SATIŞ İNDİRİMLERİ | - 33.226 | - 40.267 |
| 1-Satıştan İadeler | - 33.226 | - 40.267 |
| C-NET SATIŞLAR | 12.129.070 | 15.500.227 |
| D-SATIŞLARIN MALİYETİ(-) | - 8.029.474 | - 9.583.509 |
| 3-Satılan Hizmet Maliyeti | - 8.029.474 | - 9.583.509 |
| BRÜT SATIŞ KARI /ZARARI | 4.099.596 | 5.916.718 |
| E-FAALİYET GİDERLERİ | - 139.000 | - 179.245 |
| 2-Paz.Sat.Dağ.Gid. | - 3.600 | - 4.848 |
| 3-Genel Yönetim Giderleri | - 135.400 | - 174.397 |
| FAALİYET KARI/ZARARI | 3.960.596 | 5.737.473 |
| F-DİĞ.FAL.OL.GEL.KAR | 41.729 | 16.287 |
| 6-Menkul Kıy.Sat. Kar. | 3.482 | 3.593 |
| 7-Kambiye Karları | 36.986 | 11.585 |
| 9-Faal.İl.Diğ.Gel.Kar. | 1.261 | 1.109 |
| G-DİĞ.FAAL.GİD/ZARAR(-) | - 3.176.056 | - 2.505.170 |
| 1-Komisyon Giderleri | - 34 | - 45 |
| 4-Kambiyo Zararları | - 1.044.899 | - |
| 6-Diğ.Olağan Gid./Zarar. | - 2.131.123 | - 2.505.125 |
| H-FİNANSMAN GİDERLERİ | - 118.032 | - 157.835 |
| 1-KV.Borçlanma Gid. | - 24.487 | - 33.109 |
| 2-UV.Borçlanma Gid. | - 93.545 | - 124.726 |
| OLAĞAN KAR/ZARAR | 708.237 | 3.090.800 |
| I-OLAĞAN DIŞI GELİR/KAR | 294.655 | 389.497 |
| 1-Önceki Dön.Gel.Kar. | 291.389 | 388.519 |
| 2-Diğer Ol.Dışı Gel./Kar. | 3.266 | 978 |
| J-OLAĞAN DIŞI GİD./ZAR. | - 96.062 | - 148.466 |
| 3-Diğer Ol.Dışı.Gid ve Zar | - 96.062 | - 148.466 |
| DÖNEM KARI /ZARARI | 906.830 | 3.331.831 |

5. BULGULAR

Yukarıda verilen Bilanço ve Gelir Tablosu incelendiğinde; firmanın 31.10.2015 tarihi itibarıyla, Kısa Vadeli Yabancı Kaynaklar içerisinde; 3.346.931 \$ borç senedi, 1.745.767 \$ Ortaklara Borçlar, Uzun Vadeli Yabancı Kaynaklar içerisinde ise, 1.943.262 \$ borç senedi olmak üzere toplam 7.035.960 \$ olarak yer alan borçların 31.12.2015 tarihli bilançoda, azaldığı, Öz Kaynaklar 1.551.044 \$ dan, 8.968.688 \$'a yükselerek, 7.417.644 \$ arttığı görülmektedir. Öz kaynak artışı incelendiğinde, Sermaye, 1.475.490 \$ dan, 4.992.647 \$ artarak 6.468.137 \$'a, Dönem Karı, 906.833 \$' dan 2.424.998 \$ yükselerek 3.331.831 \$'a yükselmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Burada araştırılması gereken konu, iki aylık bir zaman içerisinde söz konusu şirketin, borçlarını 7 milyon \$ ödeyerek, öz kaynaklarını yaklaşık aynı tutarda nasıl artırdığıdır. Örneğimize konu şirketin bağlı bulunduğu diğer grup firmalarının kayda değer bir faaliyeti bulunmadığını daha önce belirtmiştik. Bu durumda belirtilen olumlu gelişmelerin kaynağını X Sağlık Hizmetleri San. Ve Tic. A.Ş. firmasında bulmamız gerekmektedir. Bu nedenle belirtilen gelişmelere konu fonların Gelir Tablosunda yer alması gerekir.

Yukarıda verilen Gelir Tablosu incelendiğinde; 31.10.2015 tarihi itibarıyla 12.148.313 \$ cironun 3.378.198 \$ artarak 15.526.511 \$'a yükseldiği görülmektedir. 31.10.2015 tarihine göre gerçekleşen ciro ortalaması $(12.148.313 / 10) 1.214.831$ olmaktadır. İki aylık zaman içerisinde gerçekleşmesi gereken ortalama ciro, $(1.214.831 * 2) 2.429.662$ \$ olup, $(3.378.198 - 2.429.662) 948.536$ \$ olumlu artış bulunmaktadır. Sağlık sektöründe kış aylarında talep artışı olduğu dikkate alındığında ciro artışı normal seyrinde gerçekleşmiştir. Buradan ciro artışında önemli bir gelişme olmadığı görülmektedir.

31.10.2015 tarihinde 8.029.473 \$ olarak gerçekleşen Satılan Hizmet Maliyeti 31.12.2015 tarihine göre 9.583.509 \$'a yükselmiştir. Maliyet gerçekleşme oranı, 31.10.2015 tarihinde $(8.029.473 / 12.129.070) \% 66$ iken, bu oran 31.12.2015 tarihinde $(9.583.508 / 15.500.227) \% 61$ olarak gerçekleşerek brüt satış karı, 1.817.122 \$ yükselerek 5.916.718 \$ olarak gerçekleşmiştir. Burada dikkati çeken konu, 3.378.196 \$ tutarındaki satışların 1.817.122 \$ brüt satış karına yansımadır. Diğer faaliyet giderlerinde yer alan 1.044.899 \$ tutarındaki kambiyo zararları sıfırlanmıştır.

Yukarıda yapılan değerlendirmelerden de anlaşılacağı üzere firma son iki ayda satılan malın maliyetinin düşürülmesi ve kambiyo zararlarının sıfırlanması, dönem karının oluşmasında önemli iki etken olarak karşımıza çıkmakta olup, her iki konunun da nedenleri araştırılmalıdır. Diğer taraftan, bilançodan görüleceği üzere geçmiş yıllardan gelen 887.727 \$ zarar bulunmaktadır. Diğer grup firmalarının önemli bir faaliyeti olmadığına göre, ortakların bu firmalardan kaynak sağlamış olmaları da mümkün görülmemektedir. Öyleyse iki aylık dönemde yaklaşık 7 milyon \$ borcun ödenerek, 7.4 milyon \$ öz kaynak artışına konu fonlar nasıl bulunmuştur? Bu sorunun cevabı aşağıda verilmiştir;

Yapılan incelemelerde, X Sağlık Hizmetleri San. Ve Tic. A.Ş. firmasının, hizmet binası yatırımıyla ilgili, tıbbi makine ve ekipmanları leasing yoluyla gerçekleştirdiği, ancak 2014 yılından 2015 yılı sonuna kadar ödenmesi gereken yaklaşık 6.561.000.-\$ borcun kaynak yetersizliği nedeniyle ödenemediği,

Leasing aracı kuruluşuna ödenmesi gereken borçların 3.346.931 \$'ı KV Yabancı Kaynaklar içerisinde Ticari Borçlarda, 1.745.767 \$ Diğer Borçlar, Ortaklara Borçlarda, 1.943.262 \$ ise U.V. Yabancı Kaynaklar içerisinde Ticari Borçlar hesabında izlenmektedir. Ödenemeyen leasing borçlarının ticari borçlar kaleminde izlenmesi, borcun işletmenin esas faaliyetleriyle ilgili tıbbi malzemelerde kullanılan sarf malzemesi, ilaç vb. yardımcı malzeme alımından kaynaklandığı izleniminin kredi kurumuna verilmek istenmesidir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

X Sağlık Hizmetleri San ve Tic. A.Ş.,nin bağlı bulunduğu X Holding A.Ş. ve leasing kurumu arasında borçların ödenmesine yönelik yeni bir anlaşma yapılmıştır. Yapılan anlaşmaya göre, Toplam 7.035.960 \$ borçtan 1.026.987 \$ ortaklardan alacak tutarı indirilerek, kalan 6.008.973 \$ tutarındaki borç, X Holding A.Ş.' ye aktarılacak, X Holding A.Ş.ise, borçları leasing kurumuna sekiz yıl içerisinde ödeyecektir. X Holding A.Ş., X Sağlık Hizmetleri Sanayi ve Tic. A.Ş.,' nin borçlarını devralacak ancak karşılığında X Sağlık Hizmetleri Sanayi ve Tic. A.Ş.,' firmasından devralınan borç kadar sermaye payı alacaktır. X Sağlık Hizmetleri Sanayi ve Tic. A.Ş.,' de X Holding A.Ş.' ye sermaye payı verecek o da karşılığında borçların ödeme planına uygun senet alacaktır. İlk aşamada ödenecek anapara borcuna ilişkin 4.992.647 \$ lık senetler karşılığında daha sonraki aşamalarda ise,1.016.326 \$ ödenecek faiz borcu ile ilgili senetler işleme alınarak sermaye artışları gerçekleştirilecektir.

X Sağlık Hizmetleri San ve Tic. A.Ş. firması belirtilen işlemle aşağıda belirtilen sonuçları elde etmek istemektedir;

Toplam 6.008.970 \$ borcun X Holding A.Ş. ' ye aktarılması karşılığında 4.992.647 \$ 'ın sermayeye ilave edilmesi ile, güçlü bir mali portre yaratılmıştır.

- Borçların dövizde endeksli olması nedeniyle 31.10.2015 tarihi itibariyle 1.044.899 \$ yılsonuna göre daha fazla tutardaki kur farkı giderleri ile satılan hizmet maliyetindeki kur farkları indirilerek dönemin yüksek kar ile sonuçlanması sağlanmıştır.

Yukarıda yapılan işlemin özüne bakıldığında, Firma borçlarını başka bir firmaya devrederek borcu devralan firmadan alınan senetler karşılığında sermaye artımına gitmektedir. Olay bu yönüyle mantıklı bulunabilir. Ancak yapılan işlemin kendi içinde büyük çelişkileri ve yanıltıcı tarafları bulunmaktadır.

X Sağlık Hizmetleri A.Ş. 31.10.2015 tarihi itibariyle borcun devri ve öz kaynak artışından önce örneğimize konu olay kayıtlarında aşağıdaki şekilde görülmektedir.

| | |
|----------------------------|--------------|
| 131- Ortaklardan Alacaklar | 1.026.987 \$ |
| 331- Ortaklara Borçlar | 1.745.767 \$ |
| 321-Borç Senetleri | 3.346.931 \$ |
| 421-Borç Senetleri | 1.943.262 \$ |

Yukarıdaki işlemin kayıtlar üzerine yansımaları aşağıda verilmiştir;(\$)

| | |
|------------------------|-----------|
| 331- Ortaklara Borçlar | 1.745.767 |
| 321- Borç Senetleri | 3.346.931 |
| 421- Borç Senetleri | 1.943.262 |

| | |
|----------------------------|-----------|
| 131- Ortaklardan Alacaklar | 1.026.987 |
|----------------------------|-----------|

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

500- Sermaye 4.992.647

590- Dönem Karı 1.016.326

Yukarıdaki işlemin analize uygun hale getirilmesi için aşağıda belirtilen düzeltmenin yapılması gerekmektedir;

DÜZELTME TABLOSU (\$)

500- Sermaye 4.992.647

590- Dönem Karı 1.016.326

331- Ortaklara Borçlar 718.797

336- Diğer Çeşitli Borçlar 5.290.176

Borcun devri ve sermaye artışına konu X Holding A.Ş. nin, X Laboratuar Hizmetleri San ve Tic. A.Ş. firmasının gelirlerinden başka fon yaratacak kaynağının bulunmaması ve her iki firmanın da aynı ortaklar tarafından sevk ve idare edildiği, borçların 8 yıl içerisinde, inceleme konusu firmanın yaratacağı fonlarla ödenerek buna bağlı olarak sermaye taahhütlerinin yerine getirilecek olması dikkate alınarak, yapılan sermaye artırımı ve borcun devri işlemi kağıt üzerinde yapılan bir işlemde öteye gitmemektedir. Kredi değerliliğinin olumlu yönde etkilenmesi için yapılan bu işlemin düzeltilmesi ve düzeltme işleminin sonuçları aşağıda belirtilmiştir;

Leasing borçları işletmenin tıbbi makine ve ekipmanların alımıyla ilgili olması, işletmenin esas faaliyeti ile yani sattığı mal ve hizmetle ilgili olmaması nedeniyle Ticari Borçlar içerisinde yer almaması gerekir. Ayrıca leasing borçlarının ödenemeyen vadesi geçmiş borçlardan olması dikkate alınarak bilançonun uzun vadeli yabancı kaynaklar bölümünde bulunması doğru bulunmamaktadır. Bu nedenle Kısa ve Uzun vadeli Ticari Borçlar içerisinde yer alan ödenemeyen leasing borçları "336-Diğer Çeşitli Borçlar" hesabına aktarılmıştır.

Devir işlemine konu borçların tamamının döviz olması nedeniyle hesaplanan kur farklarının Gelir Tablosu'ndan indirilerek bulunan dönem karı gerçek kar kabul edilmeyerek Öz Kaynaklar' dan indirilmiştir. Ayrıca döviz borçlarının iki aylık dönem içerisindeki kur farkları hesaplanarak, Gelir Tablosu'na gider yazılacağından dolayı ilgili borçlara eklenerek Öz Kaynaklar' dan indirilmelidir.

Sermaye artırımı devredilen borçlar karşılığında X Holding A.Ş. den alınan senetlerden oluşması, söz konusu senetlerin sekiz yıl vade içerisinde borçların ödenmesine göre ve X Sağlık Hizmetleri San ve Tic A.Ş. nin yaratacağı fonlarla ödenecek olması dikkate alınarak artışa konu tutar Öz Kaynaklardan indirilmelidir.

Bilançodan da görülebileceği üzere, X Sağlık Hizmetleri San ve Tic. A.Ş.,nin 6.008.973 \$ tutarındaki leasing kurumuna olan borçları, bağlı bulunulan X Holding A.Ş' ye devredilmiştir. X Holding A.Ş.,

leasing kurumu ile yaptığı sözleşmeye göre borçları sekiz yıl içerisinde ödeyecek ve ödeyeceği borçlar karşılığında X Sağlık Hizmetleri San ve Tic. A.Ş, firmasından devralınan borç kadar sermaye payı alacaktır. X Sağlık Hizmetleri San ve Tic. A.Ş,' de X Holding A.Ş.' ye sermaye payı verecek o da karşılığında borçların ödeme planına uygun senet alacaktır. İlk aşamada ödenecek anapara borcuna ilişkin 4.992.647 \$ lık senetler karşılığında daha sonraki aşamalarda ise, 1.016.326 \$ ödenecek faiz borcu ile ilgili senetler işleme alınarak sermaye artışları gerçekleştirilecektir.

X Sağlık Hizmetleri San ve Tic. A.Ş nin ağırlıklı ortağı X Holding A.Ş. olduğu ve X Holding A.Ş. deki ortakların ve holdingin X Sağlık Hizmetleri San ve Tic. A.Ş firmasından başka kayda değer fon kazandırıcı faaliyetleri bulunmadığı dikkate alındığında inceleme tarihine göre bedeli ödenmemiş ve sekiz yıl içerisinde ödenecek senetler ile yapılan sermaye artırım, tamamen fiktif yani işletmeye gerçekte fon girişi veya gruptan borç çıkışı yaratmayan kayden yapılan bir sermaye artırım işlemi göstermektedir.

Kısa vadeli kredi taleplerinin değerlendirilmesine yönelik yapılan Mali Tahlil ve İstihbarat raporları işletmelerin inceleme tarihine göre gerçek durumunu ve kredi değerliliğini gösteren çalışmalardır. Bu nedenle gruba bağlı diğer firmalara aktarılan ve henüz ödenmemiş ve uzun vadede ödenecek borçlar karşılığında grup firmalarına verilen hisse senetleri ile yapılan sermaye artışına konu tutarın, ödenmiş sermaye tutarından indirilerek ilgisi ve vadesine göre borçlara eklenmesi gerekmektedir.

6. SONUÇ

Kredi talep eden firmaların kredibilitelerini gerçekte olduğundan çok daha iyi göstererek finans kurumlarından kredi almaları, vadesinde ödenemeyen sorunlu kredilerin artmasına neden olmaktadır.

Banka kaynaklarının olması gerektiği gibi sağlam müşterilere plase edilememesi, kredi riskini yaratmaktadır. Kredi riski ise beraberinde likidite riskini getirerek, banka iflaslarına neden olabilmektedir. Bankaların iflası ise, kredilerin erken çağrılması, mudi mevduat taleplerinin karşılanamaması gibi sonuçlarıyla, bankanın portföyündeki kredi ve mevduat müşterilerinin olumsuz etkilenerek son zamanlarda sıklıkla görüldüğü üzere, ekonomik krizlere neden olabilmektedir.

Finans kurumları tarafından kredi taleplerinin değerlendirme sürecinde, varlıkların ve faaliyetlerin finansmanında özkaynak oranı yüksek olan firmalar, daha yüksek kredi notu almaktadırlar. Güçlü kredibiliteye sahip olan firmalar, kredi tutarı ve kredi koşulları bakımından daha uygun şartlarda kredi temin edebilmektedirler. Söz konusu avantaja sahip olmak isteyen bazı firmalar kredi değerliliğini gerçekte olduğundan çok daha iyi göstermek için bu yönde değişik muhasebe işlemleri yapabilmektedirler. Söz konusu uygulamalardan kanımızca en önemli olanı sermaye artışının gerçekte vadesinde ödenemeyen borçlarla yapılanıdır.

KAYNAKÇA

- Akdoğan, N., Tenker, N.,(1992) "Finansal Tablolar ve Mali Analiz Teknikleri" Ankara.
- Akgüç, Ö., (1998) "Finansal Yönetim", İstanbul, Muhasebe Enstitüsü Eğitim ve Araştırma Vakfı
Yayın No: 17.
- Arthur W. H., Wayne S. O.,(2014) "Muhasebe Denetimi "Auditing" Standartlar ve Yöntemleri",
Ankara, Bilimsel Yayınlar Derneği Yayını.
- Beyazıtlı, E., Çelik, O., Gürdal, K., (2015) "Genel Muhasebe", Ankara, Siyasal Kitapevi.
- Gül, H.,(2013) " Anonim Şirketlerde Nakdi Sermaye Taahhüdü ve Sermaye Taahhüdünün Yerine
Getirilmesinin Yaptırımları",Yaklaşım Dergisi, 249: 212-218.
- Jery J. W., Donald E. K., Paul D. K., (2005)"Accounting Principles", 7th Edition, John Wley&Sons,
Hoboken, Inc. .
- Kaderli, Y., Doğu, S., Arabacı, Ö.,(2013) "Basel III ve Yeni Türk Ticaret Kanunu'nun KOBİ'lerin
Finansman Sorunu Üzerindeki Muhtemel Etkileri", Ege Akademik Bakış / Ege Academic
Review, (4):505-513.
- Karayalçın, Y.,(1988) "Muhasebe Hukuku", Ankara, Banka ve Araştırma Enstitüsü.
- Kılıcı, E. N. (2017), "Bankacılık Sektörü Bilançolarındaki Kırılganlıklar ile Krizler Arasındaki İlişkinin
Değerlendirilmesi; Türkiye Örneği, 2000-01 Krizleri", Finans Politik & Ekonomik Yorumlar
(631):55-64
- Küçüksavaş, N., (1998)" Genel Muhasebe İlkeler ve Uygulamaları", İstanbul, Beta Basım Yayın
Dağıtım A.Ş.
- Okuyan, H. A.,(2013) "Türkiye'deki En Büyük 1000 Sanayi İşletmesinin Karlılık Analizi" Business
and Economics Research Journal, 4 (2):23-36.
- Özer, M.,(1997) "Denetim", Ankara, Özkan Matbaacılık-Gazetecilik Sanayi ve Ticaret Ltd. Şti.
- Pekdemir, R., (1994) "Mali Tablolar", İstanbul, İSMMO Yayınları.
- Sürmen, Y., (2005) "Muhasebe 2", Trabzon, Akademi Kitapevi Ltd. Şti. .
- Şahin, M., (1998) "Kredi Değerliliğini Etkileyen Muhasebe Uygulamalarının Bankalar Tarafından
Değerlendirilmesi ve Kredi Değerliliğini Yitiren Firmaların Ortak Yönlerinin Araştırılması"
(Doktora Tezi), İstanbul Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Şimga-Muşan, C., Hoşal-Akman, N.,(2010) “Principles of Financial Accounting, Fourth Edition”,
Ankara, Gazi Kitapevi.

Türker, İ. “Öz Kaynaklar: Kuramsal Yapı Ve Türkiye Mevzuatında Uygulama Deneyimi”, Muhasebe
ve Denetime Bakış, (47):65-96.

Walton, P., Walter, A., (2009) “Global Financial Accounting and Reporting Principles and Analysis”,
Hampshire, U.K., Second Edition,Cengage Learning.



THE VIEW POINT OF THE FOOD AND BEVERAGE BUSINESSES IN ISTANBUL PROVINCE ON GREEN SUPPLY CHAIN AND THEIR GREEN SUPPLY PRACTICES WITH IN THE CONTEXT OF CORPORATE SOCIAL RESPONSIBILITY

Dr. Öğr. Üyesi Oğuz DİKER*

Dr. Öğr. Üyesi Oğuz TAŞPINAR**

ABSTRACT

The concept of corporate social responsibility is associated with businesses' relations with the natural, social and economic environments and the sustainability of their activities related to these environments. The concept of corporate social responsibility is shaped around two main viewpoints. The first one is considered in organization-environment context, while the other is considered in organization-society context. The points that businesses must focus on here are the sustainability of local life and environmental values. The food and beverage sector is one of the primary areas of activity where environmental and social awareness should be at the highest level. Food and beverage businesses have an obligation to maintain a social and environmental awareness both in providing input and producing output. The awareness in question, also called 'green responsibility' today, includes pursuing environmental and social responsibilities in production activities such as purchasing, production, distribution and recycling. It is at this point that we come across green supply practices. Green supply can be defined as a combination of product design, product procurement and selection, production process, delivery of products to the end user, and the environmental concerns in recycling. The purpose of this study is to identify the viewpoint of the food and beverage businesses in Istanbul province on green supply chain and their green supply practices. The study utilizes the survey method, one of the quantitative techniques, where food and beverage business executives were asked questions using a four-dimension scale that had been tested for its reliability and validity and aims to measure the green supply perception and practices. The obtained results will be assessed on importance and performance diagram, and the assessment results will be analyzed. The results of the study will prove useful in identifying the current position of food and beverage businesses with regards to the incorporation of green supply chain and the aspects of green supply that the said businesses need to improve upon, while helping put forward suggestions on the issue.

Keywords: *Corporate Social Responsibility, Green Supply Chain, Sustainability, Food and Beverage Businesses*

Jel Codes: *Z30, Z31, Z32.*

* Tourism Faculty Çanakkale Onsekiz Mart University, Turkey oguzdiker@comu.edu.tr

** Tourism Faculty Çanakkale Onsekiz Mart University, Turkey oguztaspinar@comu.edu.tr

1. INTRODUCTION

Along with the report titled “Our Common Future” published by the United Nations in 1987, “Sustainable development” sensitivities come to the fore in environmental and social terms and accordingly to the phenomenon of “corporate social responsibility” has developed and gained importance on the organizational basis (Portney, 2005: 107). Many studies in the literature focus on the surrogate theory, institutional theory and theory of resource dependence in explaining the phenomenon of corporate social responsibility (Barney et. al, 2011; Brammer et. al, 2012; Branco and Rodrigues, 2006; McWilliam et. al, 2002; Lindgreen and Swaen, 2010). Corporate social responsibility, as an approach in the context of these institutional bases is expressed as a balanced approach that includes economic, social and environmental issues created to provide benefits to communities and people (Leonard and Rodney, 2003: 27).

Conceptually, corporate social responsibility is a set of activities to increase the overall quality of life in the environment, society and human triangle in the name of sustainable economic development of firms (Branco and Rodrigues, 2006: 113). From another perspective, corporate social responsibility is a set of strategic activities that include responsibilities such as focusing on the sustainability of local life and focusing on environmental values, which businesses must guarantee in the context of society and social sensitivities (Tai and Chuang, 2014: 122). The definitions for the concept of corporate social responsibility are shaped around two main characteristics. The first one is the interaction of enterprise and society, the other one is the voluntary efforts of the enterprises in the environment and social fields (Andersen and Larsen, 2009: 77). Corporate social responsibility activities focus on recycling and pollution reduction policies with their social cooperation in product and production processes (McWilliams et. al, 2006: 1). In the context of corporate social responsibility practices, the study focuses on sustainable supply chain practices that are environmentally friendly and sustainable.

2. CONCEPTUAL FRAMEWORK

One of the important points for businesses in the context of corporate social responsibility practices is the procurement activities (Andersen and Larsen, 2009; Carter and Jennings, 2002; Cruz, 2009; Tate et. al, 2010; Malaoni and Brown, 2006). Today, 50% of the value of a product is created by suppliers. For this reason, it is not possible for the institutions to realize their sustainability goals without including the suppliers in the process. Now customers and consumers buy products not only by thinking about the brand written on them, but also by considering the supply chains that produce and offer them (Altuntaş and Türker, 2012:45). For this reason, enterprises have had to follow more productive ways in domestic and foreign supply. Moreover, increasing environmental uncertainties and increasing environmental quality-based competition have resulted in planning of supply activities in the light of corporate social

responsibilities (Mentzer et. al, 2001: 2). Corporate social responsibility in procurement activities has created a sustainable supply chain approach. Sustainable supply chain is defined as the management of managerial materials with the purpose of managing the flow of information and fund in line with the customer and stakeholder requests and taking into account the three dimensions of sustainability (Raja et. al, 2015: 683).

While the sustainable supply chain approach represents the social and economic aspects of sustainability, environmental sustainability concerns are associated with green strategies (Masoumiket. al., 2015) and the green supply chain concept (Ahi and Searcy, 2013; Bowen et. al, 2001; Chin et. al, 2015). Green supply chain, green procurement, green production and material management are expressed as the sum of the green marketing and distribution and reverse logistics activities (Hervaniet. al., 2005: 334). One of the areas in which green supply chain practices have been extensively studied in the context of cause and effect relationship is food and beverage enterprises (Wibowo et. al., 2018; Chiu and Hsieh, 2016; Wang et. al., 2013). Food and beverage businesses must adopt green supply chain practices for environmental, economic and social sustainability. The active implementation of green supply practices is important for businesses in the food and beverage sector where competition is intense because of issues such as the impact on consumer purchases (Vachon and Klassen, 2006), the impact on consumer return tendency (Szuchnicki, 2009), the impact on business performance (Zuet.Al., 2008). However, the current state of green supply chain practices and the importance that enterprises attribute to the green supply chain need to be determined. This determination will provide the corrective measures by determining the points of superiority, weakness or importance of the food and beverage enterprises in the green supply chain applications.

3. ANALYSIS AND FINDINGS

Purpose of the study; the aim of the study is to analyze the green supply practices in food and beverage enterprises where the research is carried out by means of importance-performance analysis, to reveal the perceptions about the green supply and the current situation. Findings from the study will reveal the hierarchy of green supply practices in terms of food and beverage enterprises and help to determine their performance according to the importance levels of supply practices. In this respect, enterprises will have the opportunity to re-evaluate their service quality and supply methods.

In the literature, there are few studies on the supply of food and beverage services in the 'Green Supply in dimension. In this respect, this study is thought to be a unique aspect. In addition, the selection of importance-performance analysis method, which is a little known and applied method, also contributes to the literature related to the field. The importance-performance analysis (IPA) in service management is used as a part of quality management (Tonge and Moore 2007: 768). This analysis is a simple and effective technique for improving the quality of service (Shieh and Wu 2011; Deng 2007).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

When the literature is examined, an analysis method consisting of three stages is used for importance and performance analysis. The first stage is to take the averages of the participants' perceptions of the performance related to the product or service, and the second stage is to perform the regression analysis between the dependent variable and the performance which is the independent variable (Bacon, 2003: 60). The importance and performance matrix are important for the identification of the priorities of the managers' green supply chain practices and the intersection points of their current situation and the strategies to which these points correspond.

In this study, the points where food and beverage companies give importance to green supply practices and their performance levels were investigated by using the survey technique. Cruz and Matsypura, 2009, in order to measure the importance and performance of green supply practices of food and beverage enterprises; Davies and Konisky, 2000; Min and Galle, 1997; Sarkiset. al., 2011; Sharfmanet. al., 2009; Taylor, 1992; Winn and Roome, 1993; Data were collected with the GrSCM (Green Supply Chain Management) scale developed by Zhu and Sarkis, 2006. GrSCM defines supply chain management including green concepts, including product design, material procurement, manufacturing process, product marketing and recycling. Therefore, green food supply chain management explains the general process management of food and beverages. In this sense; Green food procurement, Green menu planning and cooking, Green package for take-out, green kitchen environment, Green dining environment, Green cleaning and post-treatment, green management policy, green customer education and green corporate social responsibility concepts are carefully considered.

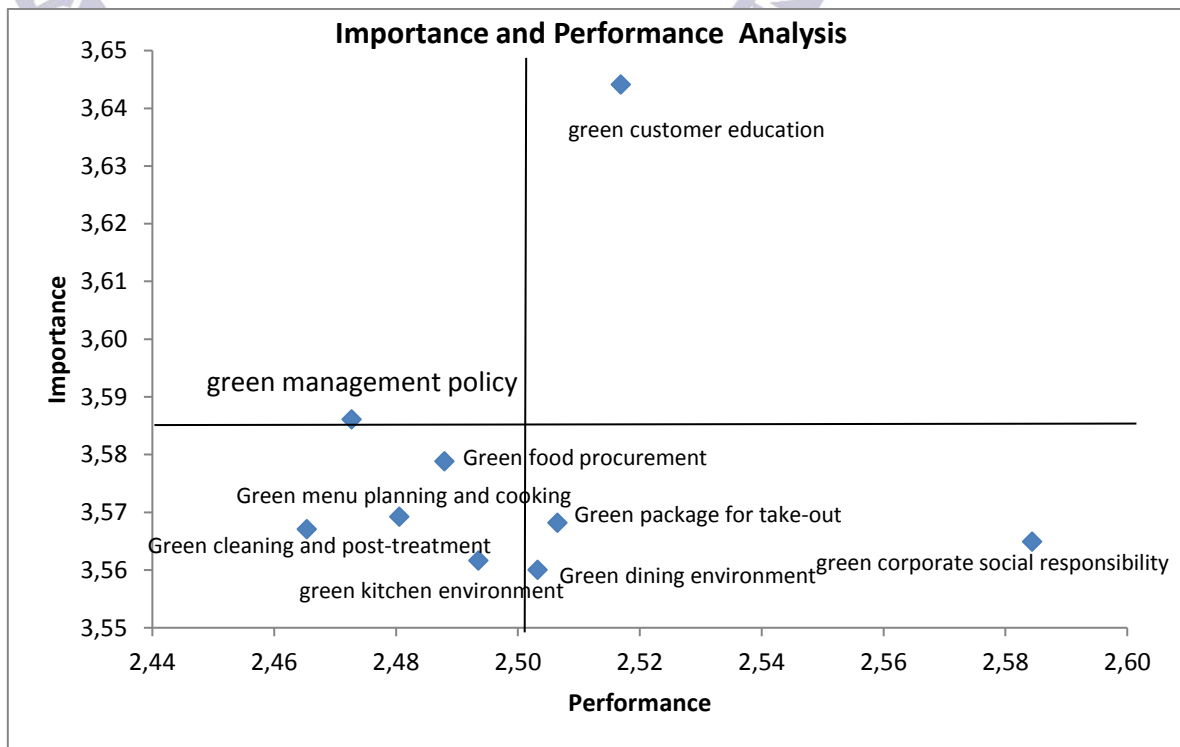
Target population of the study consists of food and beverage enterprises operating in Istanbul in 2018. Since the total number of these enterprises in Istanbul is not known, food and beverage enterprises with tourism operation certificate were examined in the study. There are 167 tourism operating certified food and beverage companies in Istanbul. 112 of these enterprises were included in the study. Considering the size of the sample, it can be said that the scale is sufficiently valid in terms of design. The scale was previously used in different researches and destinations, and factor validation was also tested. In accordance with expert opinions, it is understood that the scale has content validity for the purpose of measuring or not. The surveys prepared in this direction were applied to the managers of the enterprise and the questionnaires were evaluated with SPSS 17.0 package program. The data were evaluated with descriptive statistics; in addition, importance-performance averages and regression coefficients were obtained by Martilla and James, 1977; Albayrak 2014; Tekin, Kalkan and Duman 2014 are interpreted using the model they developed.

Table 1. Importance Perception and Performance Averages of Food and Beverages Businesses Regarding Green Supply Chain

| Dimensions | Importance | Performance |
|---------------------------------------|------------|-------------|
| Green food procurement | 3,570 | 2,493 |
| Green menu planning and cooking | 3,566 | 2,485 |
| Green package for take-out | 3,567 | 2,516 |
| Green kitchen environment | 3,561 | 2,499 |
| Green dining environment | 3,565 | 2,514 |
| Green cleaning and post-treatment | 3,569 | 2,477 |
| Green management policy | 3,591 | 2,475 |
| Green customer education | 3,642 | 2,521 |
| Green corporate social responsibility | 3,562 | 2,595 |

When the data obtained by analyses examined it can be seen that highest value for importance perception of green supply chain for food and beverages businesses is green customer education. Least value is for green institutive social responsibility and green kitchen environment. Values for green administrative policies, green customer education, green institutional socail responsibility and green packing are relatively close to each other. On the other hand, when performance averages are evaluated, most focused issues are green institutive social responsibility and green packing. Averages obtained from results analysis are expressed witch related codes while determining coordinates on the matrix.

Figure 1. Importance and Performance Matrix



4. RESULT AND EVALUATION

Within this study, importance and performance levels of food - beverages businesses operating in Istanbul are detected regarding green supply applications. Importance - performance analysis of businesses is made under 9 factors by 61 statements and the factors which business managers give importance are, respectively; *Green Serving Environment, Green Customer Education, Green Administrative Policies, Green Food Purchases, Green Menu and Preparing, Green Packing, Green Institutional Social Responsibility, Green Scullery and Green Kitchen Environment*. In other words, businesses think green supply applications significant in everyway.

Performance of business managers with respect to green supply applications from the strongest to the weakest are, respectively; *Green Institutional Social Responsibility, Green Customer Education, Green Packing, Green Serving Environment, Green Food Purchases, Green Menu and Preparing, Green Administrative Policies, Green Scullery*.

Statements of business managers regarding green supply applications with respect to importance and performance, according to their clusters are:

Cluster of things need protection: Factor in this cluster is related with Green Customer Education

Cluster of things need emphasize: Factor in this cluster is related with Green Administrative Policies.

Cluster of low priority: Factors in this cluster are related with; Green Food Purchase, Green Menu and Preparing, Green Scullery, Green Kitchen Environment.

Cluster of possible excessiveness: Factors in this cluster are related with; Green Packing, Green Serving Environment, Green Institutional Social Responsibility

Green Supply concept, is not a common term in Turkey and businesses can sense this as a vegetarian structure. Within last years, social attention to the subject is risen due to the increase at environmental problems. Chou vd., (2012) is supported that tourism and serving industry should take responsibility about the effects caused by its actions and society should have an understanding of sustainable consuming.

This study evaluates green supply applications, which are applied by Green Restaurant Association within many country in the world, and its perception and state in Turkey. This work provides administrative principles and instructions to the businesses which desires using green supply application. According to Liang vd. (2011), one of the main reasons for carbon dioxide emission is non-productive usage of equipments and facilities. Thus, restaurant and accommodation businesses should improve cooking-preparing facilities, make them better and get involved in recycling process in order to reduce their carbon foot prints. Our research is also supporting this study.

In conclusion, increase at the prices of costs such as security, hygiene-sanitation, water etc. made it difficult for food industry to use green applications. Sloan vd (2009) and Chan (2008) stated that green applications are creating excessive costs to food-beverages businesses, therefore it is really difficult to persuade business owners to green application. From this point, it can be said that findings in our research is formed due to the similiar reasons. There is need for public and private governemnts to perform some measures. To illustrate, fiscal and administrative support can be offered regarding green applications. By raising consciousness of the society and business managers about the green applications, goal of creating a sustainable world can be supported.

KAYNAKÇA

- Ahi, P., Searcy, C. (2013). "A Comparative Literature Analysis of Definitions for Green and Sustainable Supply Chain Management", *Journal of Cleaner Production*, 52: 329-341.
- Andersen, M., Larsen, S., T. (2009). "Corporate Social Responsibility in Global Supply Chains", *Supply Chain Management: An International Journal*, 14 (2): 75-86.
- Bacon, R., D. (2003). "A Comparison of Approaches to Importance-Performance Analysis", *International Journal of Market Research*, 45(1): 1-15.
- Barney, J.B, Ketchen Jr. J.,D., Wright, M. (2011). "The Future of Resource-Based Theory: Revitalization pr Decline?". *Journal of Management*, 37(5): 1299-1315.
- Bowen FE, Cousins PD, Lamming RC, Faruk AC. (2001) "The Role of Supply Management Capabilities in Green Supply". *Production and Operations Management*, 10(2):174-89.
- Brammer, S., Jackson, G., Matten, D. (2012). "Corporate Social Responsibility and Institutional Theory: New Perspectives on Private Governance", *Socio-Economic Review*, 10: 3-28.
- Branco, M. C., Rodrigues, L.L (2006). "Corporate Social Responsibility and Resource-Based Perspectives", *Journal of Business Ethics*, 68: 111-132.
- C.J. Chou, K.S. Chen, Y.Y. Wang (2012). "Green Practices in the Restaurant Industry from an Innovation Adoption Perspective: Evidence from Taiwan" *International Journal of Hospitality Management*, 31 (3): 703-711
- Carter, R. C., Jenings, M. M. (2002). "Social Responsibility and Supply Chain Relationships", *Transportation Research Part E*, 38: 37-52.
- Chan, 2008 E.S.W. (2008). "Chan Barriers to EMS in the Hotel Industry" *International Journal of Hospitality Management*, 27 (2): 187-196

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Chin, A., T., Huam, H., T., Sluaiman, Z. (2015). "Green Supply Chain Management, Environmental Collaboration and Sustainability Performance", *Procedia CIRP*, 26: 695-699.
- Chiu, J. Z., Hsieh, C. C. (2016). The Impact of Restaurants' Green Supply Chain Practices on Firm Performance. *Sustainability*, 8(1), 42, 1-14.
- Chiu, J.-Z, Hsieh, C.-C (2016). The Impact of Restaurants's Green Supply Chain Practices on Firm Performance, *Sustainability*, 2016,8 (42), 2-14.
- Cruz, M., J. (2009). The Impact of Corporate Social Responsibility in Supply Chain Management: Multicriteria Decision-Making Approach, *Decision Support Systems*, 48, 224-236.
- H. Min, W.P. Galle (1997). Green Purchasing Strategies: Trends and Implications *The Journal of Supply Chain Management*, 33 (3), pp. 10-17
- Hervani, A. A., Helms, M. M., Sarkis, J. (2005). Performance Measurement for Green Supply Chain Management. *Benchmarking: An international journal*, 12(4), 330-353.
- J.M. Cruz, D. Matsypura (2009). Supply Chain Networks with Corporate Social Responsibility Through Integrated Environmental Decision-Making *International Journal of Production Research*, 47 (3), pp
- Liang, S.C., Li, J.S., Liang, R.H., Li, J.Y., (2011). The Analysis And Comparison of The Organization's Carbon Dioxide Emission for Hotels. Presented in International Conference on Sustainable Development, Innovation & Education of Hospitality, Tourism & Leisure. Conference Proceeding, pp. 408-418.
- Lindgreen, A., Swaen, V. (2010). Corporate Social Responsibility, *International Journal of Management Reviews*, 1-7.
- M. Sharfman, T. Shaft, R. Anex (2009). The Road to Cooperative Supply-Chain Environmental Management: Trust and Uncertainty Among Proactive Firms *Business Strategy and the Environment*, 18 (1), pp. 1-13
- Maloni, M. J., Brown, E. M. (2006). Corporate Social Responsibility Chain: An Application in the Food Industry, *Journal of Business Ethics*, 68, 35-52.
- Masoumik, S., M., Abdul-Rashid, S., Olugu, E., Ghazilla, R., A., R. (2015). A Strategic Approach to Develop Green Supply Chains, *Procedia GIRP*, 26, 670-676.
- McWilliams, A., Fleet Van, D. D., Cory, D. K. (2002). Raising Rivals' Costs Through Political Strategy: An Extension of Resource-Based Theory, *Journal of Management Studies*, 39(50), 707-723.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Mentzer, J.T., DeWitt, W., Keebler, J.S., Min, S., Nix, N.W., Smith, C.D. and Zacharia, Z.G. (2002). Defining Supply Chain Management, *Journal of Business Logistics*, Vol. 22 No. 2, pp. 1-25.
- P. Sloan, W. Legrand, H. Tooman, J. Fendt (2009). Best Practice in Sustainability: German and Estonian Hotels *Advances in Hospitality and Leisure*, 5, pp. 89-107
- Portney, P. R. (2005). Corporate Social Responsibility. *Environmental Protection and the Social Responsibility of Firms—Perspectives from Law, Economics, and Business*.
- Q. Zhu, J. Sarkis (2006). An Inter-Sectorial Comparison of Green Supply Chain Management in China: Drivers and Practices *Journal of Cleaner Production*, 14 (5), pp. 472-48
- Raja, K., Stefan, S., Philip, B., Anna, L., Saadat, Y., Ralf, W. (2015). Putting Sustainable Supply Chain Management into Base of the Pyramid Research, *Supply Chain Management*, 20(6), 681-696.
- Rodney, M., Leonard, D. (2003). Corporate Governance: The International Journal of Business in Society, *The International Journal of Business in Society*, 3(4), 36-45.
- S.F. Winn, N.J. Roome R&D (1993). Management Response to the Environment: Current Theory and Implications to Practice and Research *R&D Management*, 23 (2), pp. 147-160
- S.R. Taylor (1992). Green Management: The Next Competitive Weapon Future, 24 (7), pp. 669-678
- Sarkiset. al., 2011 J. Sarkis, Q. Zhu, K.H. Lai (2011). An Organizational Theoretic Review of Green Supply Chain Management Literature *International Journal of Production Economics*, 130 (1), pp. 1-1
- Szuchnicki, A. L. (2009). Examining the Influence of Restaurant Green Practices on Customer Return Intention. *UNLV Theses, Dissertations, Professional Papers, and Capstones*. 155.
- T. Davies, D.M. Konisky (2000). Environmental Implications of the Foodservice and Food Retail Industry Resources for the Future, Washington, DC
- Tai, F.-M., Chuang, S.-H.(2014). Corporate Social Responsibility, *iBusiness*, 6, 117-130.
- Tate, L., W., Ellram, L. M., Kirchoff, J. F. (2010). Corporate Social Responsibility Reports: A Thematic Analysis Related To Supply Chain Management, *Journal of Supply Chain Management*, 46(1), 19-43.
- Vachon, S. (2007). Green Supply Chain Practices and the Selection of Environmental Technologies, *International Journal of Production Research*, 45:18-19, 4357-4379.
- Vachon, S., Klassen, D., R. (2006). Green Project Partnership in the Supply Chain: The Case of the Package Printing Industry, *Journal fo Cleaner Production*, 14, 661-671.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Wang, C.-J., Tsai, H.-T., Tsai, M.-T. (2014). Linking Transformational Leadership and Employee Creativity in the Hospitality Industry: The Influences of Creative Role Identity, Creative Self-Efficacy, and Job Complexity, *Tourism Management*, 40, 79-89.
- Wang, Y.-F., Chen, S.-P., Lee, Y.-C., & Tsai, C.-T.S. (2013). Developing Green Management Standards for Restaurants: An application of Green Supply Chain Management. *International Journal of Hospitality Management*, 34, 263-273.
- Wibowo, M. A., Handayani, N. U., & Mustikasari, A. (2018) "Factors for Implementing Green Supply Chain Management in the Construction Industry". *Journal of Industrial Engineering and Management*, 11(4): 651-679.
- Wibowo, S., Wells, M. (2018). "Green Cloud Computing and Economics of the Cloud: Moving Towards Sustainable Future". *GSTF Journal on Computing (JoC)*, 5(1).
- Zhu, Q., Sarkis, J., & Lai, K. H. (2012) "Examining the Effects of Green Supply Chain Management Practices and Their Mediations on Performance Improvements" *International Journal of Production Research*, 50(5): 1377-1394.
- Zhu, Q., Sarkis, J., Lai, K.-H. (2008). "Confirmation of a Measurement Model for Green Supply Chain Management Practices Implementation", *Int. J. Production Economics*, 261-273.

**ORTA GELİR TUZAĞI VE BEŞERİ SERMAYE: KARŞILAŞTIRMALI BİR PANEL VERİ
ANALİZİ**

Doç.Dr. Mustafa ÖZÇAĞ*

Dr.Öğr. Üyesi Mehmet BÖLÜKBAŞ**

ÖZET

Ekonomik büyüme; sermaye birikimi, tasarruflar, yatırımlar, kamu harcamaları, dış ticaret, eğitim seviyesi, araştırma geliştirme faaliyetleri, teknoloji ve beşeri sermaye gibi unsurlarla yakından ilişkilidir. Bazı ekonomiler söz konusu unsurlardaki yetersizlikler sebebiyle orta gelir tuzağına yakalanmaktadır. Çalışmanın amacı; orta gelir tuzağından çıkışta ekonomik büyüme ile beşeri sermaye arasındaki ilişkinin belirlenmesidir. Bu kapsamda, kırılğan beşli ülkeleri ile (Brezilya, Endonezya, Güney Afrika, Hindistan ve Türkiye) seçilmiş yedi gelişmiş ülke ekonomisi (ABD, Almanya, Fransa, İngiltere, İtalya, Japonya ve Kanada) arasında karşılaştırmalı bir panel veri analizi yapılmıştır. Elde edilen bulgulara göre, gelişmiş ülkelerde ekonomik büyüme, beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi ile çift yönlü nedensellik ilişkisi görülmüşken, orta gelir tuzağında olan ülkelerde söz konusu değişkenler arasında herhangi bir nedensellik ilişkisine rastlanılmamıştır.

Anahtar Kelimeler: *Ekonomik büyüme, Beşeri sermaye, Panel veri analizi.*

JEL Sınıflandırması: *F43, J24, C23, O50.*

**MIDDLE INCOME TRAP AND HUMAN CAPITAL: A COMPARATIVE PANEL DATA
ANALYSIS**

ABSTRACT

Economic growth is closely linked to factors such as capital accumulation, savings, investments, public spending, foreign trade, education level, research and development activities, technology and human capital. Some economies are caught in the middle income trap due to the lack of these variables. The aim of this study is; is the determination of the relationship between economic growth and human capital at the exit from the middle income trap. In this context, a comparative panel data analysis was carried out between the fragile five countries (Brazil, Indonesia, South Africa, India and Turkey) and selected seven developed economies (USA, Germany, France, Britain, Italy, Japan, Canada). According to the findings, while there is a bi-directional causality relationship with economic growth, human

* Aydın Adnan Menderes Üniversitesi, Aydın İktisat Fakültesi, İktisat Bölümü, Aydın, Türkiye, e-mail: mozcag@adu.edu.tr

**Aydın Adnan Menderes Üniversitesi, Aydın İktisat Fakültesi, İktisat Bölümü, Aydın, Türkiye, e-mail:

mbolukbas@adu.edu.tr

capital index and education index in developed countries, no causality relationship was found between these variables in middle income trap countries.

Keywords: *Economic growth, Human capital, Panel data analysis*

JEL Classification: *F43, J24, C23, O50.*

1.GİRİŞ

Büyüme sürecini marjinal fayda kuramı temelinde şekillendiren Neo-Klasik iktisat anlayışında sermaye kavramı, 1980'li yıllara kadar sadece fiziki çerçevede ele alınmıştır. Teknoloji ve yenilik gibi kavramlar dışsal değişkenler olarak kabul edilmiş ve bunların yarattığı değişimler analiz dışında bırakılmıştır. Uzun dönemde ülkeler arasındaki kişi başına milli gelir farklılıklarının ortadan kalkacağını ileri süren Neo-klasik büyüme modeli, gelişmiş ülkeler lehine ortaya çıkan büyüme farklılıklarının dışsal olarak kabul edilen teknolojik yenilik ve verimlilik artışları ile açıklanmasını da gerekli kılmıştır (Yülek, 1997). Nitekim bu büyüme modeli, tüm ülkelerde var olan teknolojik düzeyin aynı olduğu varsayımı altında, uzun dönemli büyüme oranının sıfır olacağını, bu nedenle de hükümet politikalarının uzun dönemli büyüme süreçleri üzerinde etkilerinin oldukça zayıf kalacağını ileri sürmektedir (Kibritçioğlu, 1998). Temelleri Smith, Schumpeter, Kaldor ve Arrow gibi iktisatçıların söylemlerine dayanan yenilik ve girişimcilik gibi kavramların tekrar ele alınmasıyla oluşturulan yeni teorik çerçeve, Paul Romer'in 1986 yılında yayınladığı "Increasing Returns and Long Run Growth" çalışması ile gerçekleşmiş ve Neo-klasik büyüme teorisine karşı bir alternatif oluşturulmuştur. Romer çalışmasında, üretimde marjinal etkinliği arttıran bir girdi olarak kabul ettiği bilgiyi ön plana çıkarmakta ve araştırma geliştirme faaliyetlerinde çalışan beşeri sermaye unsurunun yeni üretim tekniklerinin oluşumuna öncülük etmesine büyük önem atfetmektedir (Romer, 1986: 1002). Ekonomik büyümenin gerçekleştirilmesinin sadece sermaye birikimi ile sağlanamayacağını ileri süren, inovasyon ve teknolojiye atıf yapan Romer'den sonra Lucas'ın 1988 yılında yayınladığı "On the Mechanics of Economic Development" başlıklı çalışması ise beşeri sermaye kavramını içsel büyüme teorilerine yerleştiren temel eserlerden biri niteliğini taşımaktadır. Temelleri 1960'lı yıllarda Schultz tarafından oluşturulan beşeri sermaye kavramı, bir ekonomideki bilgi ve beceri yüklü nitelikli işgücünü ifade etmektedir (Şimşek ve Kadılar, 2010: 117). Lucas, fiziki sermaye birikimi ve teknolojik ilerlemeyi, okullaşma yoluyla insan sermayesi birikimini ve yaparak öğrenme yoluyla özel insan sermayesi birikimini üç ayrı şekilde modellediği çalışması ile içsel büyüme teorisine farklı bir boyut kazandırmıştır (Lucas, 1988).

Lucas'ın, fiziki sermaye ve emeğin verimliliğini arttıran bir güç olarak gördüğü beşeri sermaye ile ekonomik büyüme süreçleri arasında vurgulanan bu önemli ilişki, kişi başına milli gelir seviyelerini belli bir düzeyin üzerine çıkartamayan orta gelir tuzağındaki ülkeler için de büyük önem taşımaktadır. İlk kez Indermit Gill ve Kharas tarafından 2007 yılında Dünya Bankası için hazırlanan "An East Asian

Renaissance: Ideas for Economic Growth isimli raporda kullanılan orta gelir tuzağı kavramı; bir ülkenin kişi başına düşen milli gelir düzeyi bakımından, düşük gelirli ülke grubundan orta gelirli ülke grubuna geçtikten sonra, bazı ekonomik, sosyal ve kurumsal nedenlerden dolayı, yüksek gelirli ülkeler grubuna yükselmemesi olarak ifade edilmektedir. Rapor'da orta gelir seviyesine ulaşan ülkelerin düşük gelirli ülkeleri ile yüksek gelir grubu ülkeler arasında sıkışıp kaldığı belirtilmiştir (Gill ve Kharas, 2007: 5). Ülkelerin orta gelir tuzağından çıkamayışlarındaki temel etkenler olarak düşük tasarruf düzeyi, buna bağlı olarak yatırım seviyesinin düşük kalması, inovatif ürünler ihraç eden ülkelerin mallarıyla uluslararası alanda rekabet edememeleri gibi unsurlar gösterilmektedir. Teorik olarak, orta gelir düzeyine sahip olan ülkelerde düşük beşeri sermaye yoğun üretimden yüksek beşeri sermaye yoğun üretime geçilmesi ile yani emek kalitesinde bir dönüşümün ortaya çıkmasıyla beraber orta gelir düzeyinden çıkılması beklenmektedir. Bu aşamada nitelikli işgücünün varlığı büyük önem taşımaktadır. Orta gelir düzeyine ulaşan ekonomiler, yükselen ücret düzeyleriyle birlikte emek yoğun sektörlerdeki karşılaştırmalı üstünlüklerini kaybetmekte, bununla birlikte beşeri sermaye ve teknolojiye yetersiz kalındığında orta gelir tuzağına takılmaktadırlar (Tho, 2013: 5).

Bir ülkenin orta gelir grubunda yer alıp almadığının belirlenebilmesi için öncelikle ülkelerdeki kişi başına gelir düzeylerinin tespit edilmesi gerekmektedir. Bu kapsamda Dünya Bankası, geliştirdiği Atlas Metodu ile enflasyonun yarattığı kur artışlarını minimize ederek, ülkelerde kişi başına düşen gelirleri hesaplamakta ve bir sınıflandırma oluşturmaktadır. Bu yöntemle, Dünya Bankası'nın 2017 yılı için belirlemiş olduğu gelir düzeylerine göre ülke grupları aşağıdaki gibidir:

Tablo 1. Dünya Bankası'na Göre Ülkelerin Gelir Grupları Açısından Sınıflandırılması

| Ülke Grupları | Kişi Başına Düşen Yıllık Ortalama Gelir | Ülke Sayısı |
|-------------------------------|---|-------------|
| 1)Düşük Gelirli Ekonomiler | 1.025 Dolar ve Daha Düşük | 31 |
| 2)Orta Gelirli Ekonomiler | 1.026-12.475 Dolar Arası | 111 |
| - Alt-Orta Gelirli Ekonomiler | 1.026-4.035 Dolar Arası | 55 |
| - Üst-Orta Gelirli Ekonomiler | 4.036-12.475 Dolar Arası | 56 |
| 3)Yüksek Gelirli Ekonomiler | 12.476 Dolar ve Üzeri | 79 |

Amerika Birleşik Devletleri merkezli bir yatırım bankası olan Morgan Stanley tarafından 2013 yılında "Kırılgan Beşli" ülkeleri olarak adlandırılan Brezilya, Endonezya, Güney Afrika, Hindistan ve Türkiye, Dünya Bankası'nın yapmış olduğu yukarıdaki sınıflandırmada orta gelirli ekonomiler grubunda yer almaktadırlar. Söz konusu ülkelerin kırılgan olarak adlandırılmalarının sebebi; bu ülkelerde yaşanan enflasyon oranları ve cari açık artışlarının döviz kurları üzerinde baskılar yaratarak gelecek dönemlerde yerli paralarının yabancı paralar karşısında değer kaybedeceği öngörüsüdür (Akel, 2015: 77). Bu

çerçeve de kırılğan beşli ekonomilerinde, yüksek enflasyon, büyümenin yetersizliği, yüksek cari açıklar, yabancı sermayeye olan yüksek bağımlılık gibi konular ortak sorunlar olarak karşımıza çıkmaktadır.

2.LİTERATÜR TARAMASI

Çalışmanın konusuna ilişkin yapılan literatür taramasında ulaşılan kaynakların büyük bir çoğunluğunda, beşeri sermaye faktörü ile ekonomik büyüme arasında anlamlı ve pozitif ilişkilere ulaşıldığı görülmektedir. Literatür taraması özeti aşağıdaki tabloda verilmiştir.

Tablo 2. Literatür Taraması Özeti

| Çalışmanın Yazar(lar)ı ve Yılı | Çalışmanın Örnekle mi | Çalışmanın Dönemi | Çalışmada Kullanılan Yöntem(ler) |
|---|---|-------------------|--|
| Ali, Egbetokun ve Memon (2018) | 132 ülke | 1996-2011 | Panel veri analizi |
| | Sonuç: Ekonomik koşulların iyileştiği ve yüksek kaliteli kurumların olduğu durumlarda beşeri sermayenin kişi başına düşen GSYH'de artışa yol açacağı belirtilmiştir. | | |
| Bozkurt ve Balmumcu (2018) | 30 gelişmekte olan ülke | 1970-2014 | Panel eşbütünleşme analizi |
| | Sonuç: Beşeri sermaye ve ekonomik büyüme arasında bir eşbütünleşme ilişkisinin olduğu sonucuna varılmıştır. | | |
| Daşçı ve Cemaloğlu (2018) | 13 OECD ülkesi | 1999-2014 | Panel VAR analizi |
| | Sonuç: Beşeri sermayeye yapılan harcamaların ekonomik büyümeye etkisi araştırılmış ve sağlık harcamaları ve GSYİH arasında çift yönlü nedensellik tespit edilmiştir. Ayrıca varyans ayrıştırması sonuçlarına göre, GSYİH'da meydana gelen değişimin %14'ünün sağlık harcamaları ile %7'si eğitim harcamaları ile açıklanmaktadır. | | |
| Ogunleye, Owolabi, Sanyaolu, Lawal (2017) | Nijerya | 1981-2015 | En küçük kareler yöntemi |
| | Sonuç: Beşeri sermayede yaşanan gelişmelerin ekonomik büyüme üzerinde etkisi olduğu sonucu elde edilmiştir. Bununla birlikte sağlık harcamaları, eğitim harcamaları ve okullaşma oranı gibi değişkenlerin ekonomik büyüme üzerinde pozitif ve anlamlı etkileri olduğu izlenmiştir. | | |
| Topallı (2017) | Türkiye | 1960-2012 | Vecm modeli ve Toda-Yamamoto nedensellik testi |

| | | | |
|------------------------------------|--|------------------------|---|
| | Sonuç: Mesleki ve teknik okullardan diploma alanların sayısından kişi başına reel GSYİH'ye doğru tek yönlü nedensellik ve kişi başına reel GSYH'den yüksek eğitim kurumlarından diploma alanların sayısına doğru tek yönlü nedensellik olduğu belirlenmiştir. | | |
| Manga, Bal, Algan ve Kandır (2015) | Türkiye ve BRICS ülkeleri | 1995-2011 | Panel veri analizi |
| | Sonuç: Türkiye ve BRICS ülkelerinde beşeri sermaye ve ekonomik büyüme arasında uzun dönem ilişkisi olduğu sonucuna ulaşılmıştır. | | |
| Pelinescu (2015) | AB ülkeleri | 1990-2000 2000-2012 | Panel veri analizi |
| | Sonuç: Çalışmada GSYİH ile beşeri sermaye arasında istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif bir ilişki olduğu ifade edilmektedir. | | |
| Pamuk ve Bektaş (2014) | Türkiye | 1998-2013 | ARDL sınır testi yaklaşımı ve Granger nedensellik testi |
| | Sonuç: Eğitim harcamaları ve ekonomik büyüme arasındaki ilişki analiz edilmiş ancak değişkenler arasında herhangi bir eşbütünlük ilişkisi tespit edilememiştir. Bununla birlikte değişkenler arasında tek yönlü bir nedensellik ilişkisinin mevcut olduğu görülmüştür. | | |
| Arabi ve Abdalla (2013) | Sudan | 1982-2009 | Eşanlı denklem modeli |
| | Sonuç: Eğitim kalitesinin ekonomik büyüme üzerinde etkin olduğu, sağlıkta meydana gelen iyileşmelerin de ekonomik büyümeyi pozitif yönde etkileyeceği ifade edilmiştir. | | |
| Keskin (2011) | 177 Birleşmiş Milletler üyesi ülkeler | 1990-2003 | Çoklu doğrusal regresyon modeli |
| | Sonuç: Regresyon sonuçları, ekonomik kalkınmada okuma yazma oranının, eğitim düzeyinin, kamu sağlık harcamalarının ve araştırma geliştirme harcamalarının önemli etkisinin olduğunu ortaya koymuştur. | | |
| Daşdemir (2008) | AB üyesi ülkeler | 1990-2005 | Panel veri analizi |
| | Sonuç: Avrupa Birliği üyesi ülkelerde beşeri sermaye ve ekonomik büyüme arasında pozitif bir ilişki olduğu sonucu elde edilmiştir. | | |

| | | | |
|---------------------|--|-----------|---|
| Kar ve Ağır (2006) | Türkiye | 1926-1994 | Eşbütünleşme testi ve Granger nedensellik testi |
| | Sonuç: Çalışmada ekonomik büyüme ve beşeri sermaye arasındaki ilişki incelenmiş ve elde edilen bulgulara göre, değişkenler arasındaki nedensellik ilişkisinin seçilen beşeri sermaye göstergesine duyarlı olduğunu ortaya koymuştur. | | |
| Taban ve Kar (2006) | Türkiye | 1969-2001 | Granger nedensellik testi ve Johansen eşbütünleşme testi |
| | Sonuç: Beşeri sermaye ile ekonomik büyüme arasındaki nedensellik ilişkisinin yönünün beşeri sermaye göstergesine göre farklılık gösterdiği belirlenmiştir. Yazarlara göre bu bulgular, ekonomik büyümenin bir taraftan beşeri sermayeyi belirlediğini, diğer taraftan beşeri sermaye tarafından belirlendiğini göstermektedir. | | |
| Freire-Seren (2001) | 65 ülke | 1960-1990 | Panel Granger nedensellik testi ve panel eşbütünleşme analizi |
| | Sonuç: Beşeri sermayenin ekonomik büyümeyi etkilediği, ekonomik büyümenin de beşeri sermaye birikimini artırdığı sonucuna ulaşılmıştır. | | |
| Romer (1989) | 121 ülke | 1960-1985 | İçsel büyüme modeli |
| | Sonuç: Beşeri sermaye faktörü olan eğitim düzeyinin ekonomik büyüme üzerinde pozitif etkisi olduğu tespit edilmiştir. | | |

3.EKONOMETRİK ANALİZ VE BULGULAR

Çalışmada orta gelir tuzağında yer almayan ülkelerde ve orta gelir tuzağında bulunan ülkelerde beşeri sermayenin ekonomik büyüme ile ilişkisi panel veri analizi ile incelenerek ülke grupları karşılaştırılmıştır. Bu kapsamda ABD, Almanya, Fransa, İngiltere, İtalya, Japonya ve Kanada ülkeleri orta gelir tuzağında olmayan ülkeler olduğu için bu ülkeler bir grupta yer almakta ve çalışmada G7 olarak adlandırılmaktadır. Diğer yandan, Dünya Bankası (2017) raporlarına göre²⁰ orta gelir tuzağında olan Brezilya, Endonezya, Güney Afrika, Hindistan ve Türkiye de ikinci bir grupta yer almakta ve orta gelir tuzağındaki bu ülkeler de çalışmada K5 olarak anılmaktadır. Ülkelerin beşeri sermaye endeksi çeşitli sosyal faktörler dikkate alınarak Birleşmiş Milletler Kalkınma Programı (UNDP) tarafından

²⁰ Dünya Bankası ülkelerin orta gelir tuzağında olup olmadığını çeşitli yöntemlerle hesaplamakta ve raporlar halinde sunmaktadır. Orta gelirli ülkeler seçilirken bu raporlar dikkate alınmış ve kırsal ülkeler olarak da bilinen beş ülke seçilmiştir.

hesaplanmakta ve ülkeler beşeri sermayelerine göre sıralanmaktadır. Aşağıda yer alan tablo ele alınan ülke grubunda beşeri sermaye endeks değerlerini göstermektedir.

Tablo 3. Ülkelerin Beşeri Sermaye Endeksleri (2017)

| Ülkeler (G7) | Beşeri Sermaye Endeksi | Ülkeler (K5) | Beşeri Sermaye Endeksi |
|--------------|------------------------|--------------|------------------------|
| ABD | 0.92 | Brezilya | 0.76 |
| Almanya | 0.94 | Endonezya | 0.69 |
| Fransa | 0.90 | Güney Afrika | 0.70 |
| İngiltere | 0.92 | Hindistan | 0.64 |
| İtalya | 0.88 | Türkiye | 0.79 |
| Japonya | 0.91 | | |
| Kanada | 0.93 | | |

Kaynak: UNDP (2018)

Tablodan anlaşılacağı üzere orta gelir tuzağında olmayan ülkeler kategorisindeki yedi ülke beşeri sermaye endeksi bakımından birbirlerine oldukça yakın olmakla beraber en düşük beşeri sermaye endeksine sahip olan ülke İtalya'dır. Bununla birlikte orta gelir tuzağında olan ülkelerin de yine beşeri sermaye endeksleri birbirine yakın görünmekte ve en yüksek beşeri sermaye endeksine sahip olan ülke Türkiye'dir.

Türkiye'nin de içinde bulunduğu 12 ülke çalışma kapsamına dâhil edilmiş ve beşeri sermaye ve ekonomik büyüme arasındaki ilişkinin incelenmesi için ekonometrik analizden yararlanılmıştır. Çalışmada kullanılan beşeri sermaye endeksi yukarıda bahsedildiği gibi UNDP'den (2018) temin edilmiştir. Beşeri sermaye endeksinin yanında yine UNDP (2018) tarafından hazırlanan eğitim endeksi de bu çalışmada modele dâhil edilmiş ve ekonomik büyüme ile nedensellik ilişkisi araştırılmıştır. Ekonomik büyüme değişkeni olarak kullanılan ülkelerin GSYH'deki yüzde değişimi ise Dünya Bankası'ndan (2018) sağlanmıştır. Çalışmanın dönemi verilerin elde edilebilirliğine göre belirlenmiş olup, 1990-2017 olarak düzenlenmiştir. Bu veriler kullanılarak oluşturulan model şu şekildedir;

$$BY_{it} = a_{1i} + a_{2i}BS_{it} + a_{3i}EG_{it} + U_{it} \quad (1)$$

Bu modelde yer alan BY, ekonomik büyümeyi, BS, beşeri sermaye endeksini, EG eğitim endeksini, U hata terimini, a 'lar katsayıyı, değişkenlerin altında yer alan i 'ler ve t 'ler sırasıyla, değişkenlere ait kesit veri boyutunu ve zaman serisi boyutunu ifade etmektedir. Bu model yardımıyla değişkenler arasındaki nedensellik ilişkisi incelenmek istenmiş ve bunun için VAR temelli panel Granger nedensellik testi uygulanmıştır. Ancak nedensellik testlerine geçmeden önce bazı ön testler yapılmıştır.

Değişkenler arasında nedensellik ilişkisinin tespit edilmesinden önce serilerin durağanlığının araştırılması gerekmektedir. Çünkü durağan olmayan serilerle yapılan tahminler sahte regresyon

sorununa yol açabilmektedir. Bu çalışmada serilerin durağanlığı birinci nesil birim kök testleri olan Levin, Lin ve Chu (LLC), Im, Pesaran ve Shin (IPS), Fisher ADF ve Fisher PP testleri ile araştırılmıştır. Bu testler seçilmeden önce serilere yatay kesit bağımlılığı testi yapılmış ancak seriler düzeyinde ve model düzeyinde yatay kesit bağımlılığına rastlanmadığı için yöntem olarak birinci nesil panel veri analizlerinden yararlanılmıştır. Durağanlık testlerinin ardından panel nedensellik testine geçilmiş ve ilk olarak her iki ülke grubu için de bir panel VAR modeli oluşturularak uygun gecikme sayısı belirlenmiştir. VAR modeli ile gecikme uzunluğu belirlenirken Son Tahmin Hatası Kriteri (Final prediction error-FPE), Akaike Bilgi Kriteri (Akaike Information Criterion-AIC), Schwarz Bilgi Kriteri (Schwarz Information Criterion-SC) ve Hannan-Quinn Bilgi Kriteri (Hannan-Quinn Information Criterion-HQ) sıklıkla kullanılmaktadır (Johansen, 1995; Enders, 1995). Bu bilgi kriterlerine göre her iki ülke grubunda da uygun gecikme üç çıkmış ve bu gecikme uzunluğunun model doğrulama testlerinden başarıyla geçtiği izlenmiştir. Nedensellik testinden önce beşeri sermaye endeksi, eğitim endeksi ve ekonomik büyüme ilişkisine yönelik ön bir bulgu elde etmek için korelasyon analizi ve serpilme diyagramına da yer verilmiştir.

3.1. Panel Birim Kök Testleri ve Bulgular

Çalışmada değişkenlerin durağanlık düzeyleri Levin, Lin ve Chu (LLC), Im, Pesaran ve Shin (IPS), Fisher ADF (Augmented Dickey Fuller) ve Fisher PP (Phillips-Perron) testleri ile incelendiği için bu testlere dair kısa bir bilgilendirmeye yer verilmiştir. LLC panel birim kök testinde tüm birimler aynı otoregresif parametreye sahipmiş gibi yaklaşılır ve bu test t temelli bir testtir. bu testin hipotezleri şu şekildedir (Tatoğlu, 2012: 200);

$H_0: \rho_i = \rho = 1$ Seride birim kök sorunu vardır, durağan değildir.

$H_1: \rho_i = \rho < 1$ Seride birim kök sorunu yoktur, durağandır.

IPS panel birim kök testi de tüm birimler için zaman serilerine ayrı ayrı birim kök testi uygulayarak tüm bireysel ADF test istatistiklerinden bir ortalama oluşturur. Bu testin hipotezleri de LLC'de olduğu gibidir ve test t ve n'nin sırasıyla sonsuza gittiği durumda asimptotik olarak geçerlidir. Son olarak Fisher ADF ve Fisher PP birim kök testleri de öncelikle her bir birim için birim kök testi yapılmakta, daha sonra bu testlerden elde edilen p-değerleri tüm testi oluşturmak için kullanılmaktadır. Dolayısıyla bu her iki testin de zaman serileri için olan klasik ADF ve klasik PP testinin her bir birim için uygulanmasıdır denilebilir (Tatoğlu, 2012: 212-214).

Tablo 4. Panel Birim Kök Test Sonuçları (G7)

| | BY | BS | EG |
|---|--------------------|----------------------|----------------------|
| Levin, Lin & Chu | -7.224* (0.000) | -4.831* (0.000) | -4.824* (0.000) |
| Im, Pesaran & Shin | -6.764* (0.000) | -1.577*** (0.057) | -1.528*** (0.063) |
| ADF Fisher | 71.241* (0.000) | 29.073** (0.010) | 29.712* (0.008) |
| PP Fisher | 93.127* (0.000) | 74.888* (0.000) | 67.617* (0.000) |
| *, **, *** sırasıyla %1, 5 ve 10 düzeyinde anlamlılığı göstermektedir. LLC testinde Barlett Kernel metodu kullanılmış ve Bandwith genişliği Newey-West yöntemi ile belirlenmiştir. Parantez içindeki değerler olasılığı ifade etmektedir. | | | |

Tablo 4, orta gelir tuzağında olmayan ve çalışmaya dahil edilen seçilmiş yedi gelişmiş ülkenin serileri için yapılan panel birim kök testi sonuçlarını göstermektedir. Tablo'dan görülebileceği üzere; ekonomik büyüme, beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi serileri düzeyde durağandır. Bu nedenle fark alma işlemine gidilmeden serilerin düzey değerleri ile tahmin yapılmıştır.

Orta gelir tuzağında olan ve çalışmaya dâhil edilen kırılğan beşliülkelerinin serileri için de yine panel birim kök testleri yapılmış ve sonuçlar aşağıdaki tabloda gösterilmiştir.

Tablo 5. Panel Birim Kök Test Sonuçları (K5)

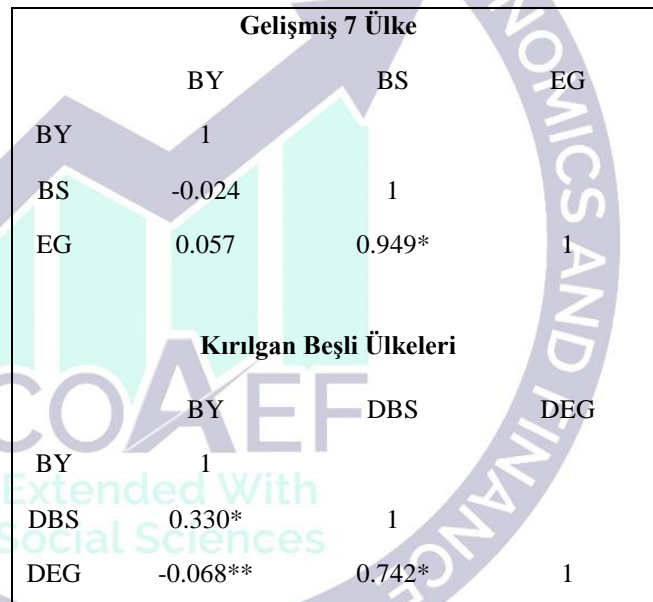
| | BY | BS | DBS | EG | DEG |
|---|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Levin, Lin & Chu | -5.417* (0.000) | -1.33*** (0.090) | -3.920 (0.000) | -0.405 (0.342) | -3.478 (0.000) |
| Im, Pesaran & Shin | -4.736* (0.000) | 1.831 (0.966) | -4.854 (0.000) | 1.913 (0.972) | -4.043 (0.000) |
| ADF Fisher | 48.131* (0.000) | 8.550 (0.858) | 51.994 (0.000) | 9.511 (0.797) | 41.444 (0.000) |
| PP Fisher | 71.162* (0.000) | 12.580 (0.559) | 87.319 (0.000) | 9.227 (0.816) | 65.915 (0.000) |
| *, **, *** sırasıyla %1, 5 ve 10 düzeyinde anlamlılığı göstermektedir. LLC testinde Barlett Kernel metodu kullanılmış ve Bandwith genişliği Newey-West yöntemi ile belirlenmiştir. Parantez içindeki değerler olasılığı ifade etmektedir. | | | | | |

Tablo 5’de yer alan birim kök test sonuçlarına göre; kırılğan beşli ülkeler için ekonomik büyüme serisi düzey değerinde, beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi ise birinci farkı alındığında durağan olmaktadır. Bu nedenle bu ülke grubu için yapılan tahminde, ekonomik büyüme serisi düzey değeri kullanılarak, beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi serileri ise fark değeri kullanılarak analiz yapılmıştır.

3.2.Önsel Testler ve Bulgular

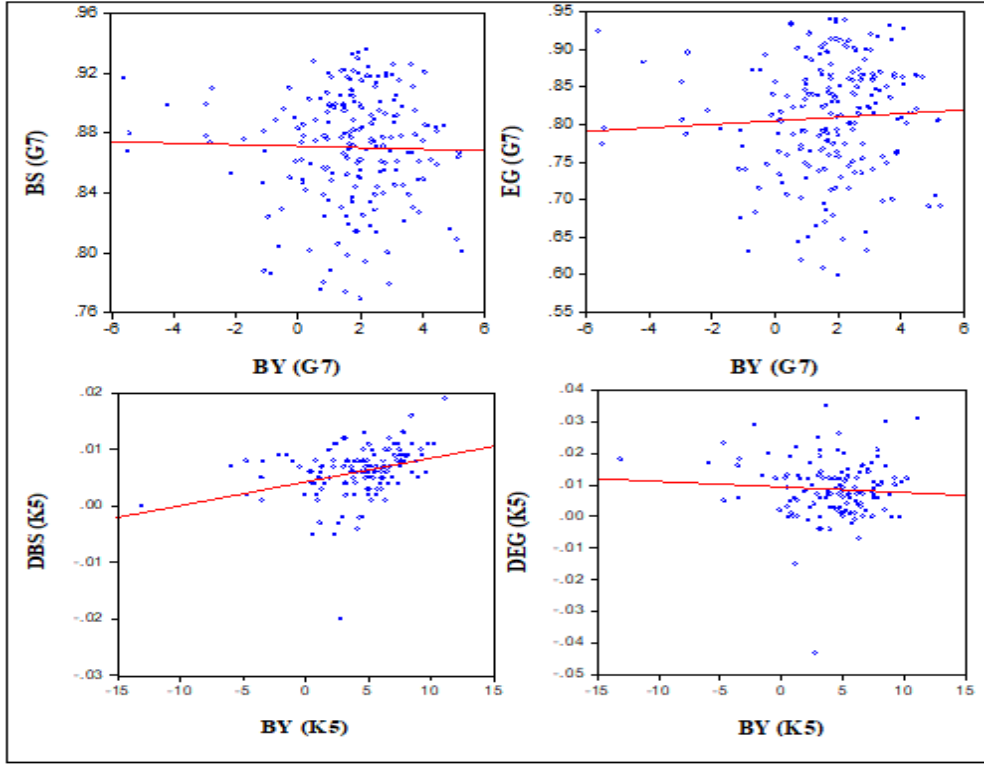
Birim kök testlerinin ardından panel nedensellik testine geçmeden önce değişkenler arasında ön bir bulgu edinmek amacıyla korelasyon analizi ve serpilme diyagramları oluşturulmuştur.

Şekil 1. Pearson Korelasyon Katsayıları



Korelasyon analizi, orta gelir tuzağında olmayan ülkelerde beşeri sermaye ve eğitim endeksi arasında istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif bir korelasyon olduğunu göstermektedir. Orta gelir tuzağında olan ülke grubu için yapılan korelasyon analizi ise, ekonomik büyüme ve beşeri sermaye arasında pozitif, ekonomik büyüme ve eğitim endeksi arasında ise negatif bir korelasyon olduğunu ifade etmektedir.

Şekil 2. Ekonomik Büyüme ile Beşeri Sermaye Endeksi ve Eğitim Endeksi İlişkisi



Şekil 2’de gösterilen serpilme diyagramları ekonomik büyüme ile beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi için ayrı ayrı oluşturulmuş ve değişkenlere yönelik gözlemlerin dağılımını göstermektedir. Bu dağılımlara bakıldığında korelasyon sonuçlarına paralel bulguların elde ettiği görülmektedir.

3.3. Panel Granger Nedensellik Testi ve Bulgular

Literatürde nedensellik testi Granger (1969) ile başlamış ve günümüzde halen geliştirilmektedir. Granger (1969) nedensellik testine göre, X ve Y değişkenlerinin kullanıldığı bir modelde, X değişkenine ait bilgilerin modele dâhil edilmesiyle birlikte, Y değişkeninin öngörüsüne bir katkı söz konusu ise, X değişkeni, Y değişkeninin nedeni olarak ifade edilmekte ve “nedenselliğin yönünün X’den Y’ye doğru olduğuna” karar verilmektedir. Bu testin temel hipotezi “X’den Y’ye nedenselliğin olmadığı” şeklinde iken, alternatif hipotez ise “X’den Y’ye nedenselliğin olduğu” biçimindedir. Üç gecikmeli VAR modeli kurularak yapılan panel Granger nedensellik testinin sonuçları Tablo 6’da sunulmuştur.

Tablo 6. Panel Granger Nedensellik Test Sonuçları (Gelişmiş 7 Ülke)

| Temel hipotez | İstatistik | Olasılık | Karar |
|---------------------|------------|----------|-----------------|
| BY \Rightarrow BS | 24.343 | 0.000 | Nedensellik var |
| BS \Rightarrow BY | 10.340 | 0.015 | Nedensellik var |
| BY \Rightarrow EG | 25.283 | 0.000 | Nedensellik var |
| EG \Rightarrow BY | 9.967 | 0.018 | Nedensellik var |

Granger Nedensellik Testi sonuçlarının sunulduğu Tablo 6'ya göre, orta gelir tuzağında olmayan ülkelerde hem ekonomik büyüme ve beşeri sermaye endeksi arasında, hem de ekonomik büyüme ve eğitim endeksi arasında çift yönlü nedensellik ilişkisi bulunmaktadır. Elde edilen bu bulgu gelişmiş ülkeler olan bu yedi ülkede beşeri sermaye unsurlarının ekonomik büyüme ile ilişkili olduğunun görülmesi açısından önemli görülmektedir. Orta gelir tuzağında olan ve modele dahil edilen beş ülke için yapılan panel Granger nedensellik test sonuçları da aşağıdaki tabloda yer almaktadır.

Tablo 7. Panel Granger Nedensellik Test Sonuçları (Kırılgan Beşli Ülkeleri)

| Temel hipotez | İstatistik | Olasılık | Karar |
|---------------|------------|----------|-----------------|
| BY→ DBS | 0.355 | 0.949 | Nedensellik yok |
| DBS→ BY | 5.943 | 0.114 | Nedensellik yok |
| BY → DEG | 0.129 | 0.988 | Nedensellik yok |
| DEG → BY | 0.704 | 0.872 | Nedensellik yok |

Orta gelir tuzağında olmayan ülkeler için elde edilen bulguların aksine orta gelir tuzağında olan ve çalışmada K5 ülkeleri olarak adlandırılan Brezilya, Endonezya, Güney Afrika, Hindistan ve Türkiye'de ekonomik büyüme ile beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi arasında herhangi bir nedensellik ilişkisine rastlanmamıştır. Bu sonuç orta gelir tuzağından kurtulmak için bu ülkelerde beşeri sermayeye önem verilmesi gerektiği konusunu gündeme getirmekle birlikte, ülkelerin beşeri sermaye düzeyinin geliştirilmesi konusunda yeni politika ihtiyacını da göstermektedir.

4. SONUÇ

Çalışmada, Dünya Bankası sınıflandırmasına göre, orta gelirli ülkeler grubunda yer alan ve Morgan Stanley'in 2013 yılındaki sınıflandırmasına göre orta gelir tuzağında yer alan Brezilya, Endonezya, Güney Afrika, Hindistan ve Türkiye örneklem olarak seçilmiş ve bu ülkelerde ekonomik büyümenin beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi ile nedensellik ilişkisi test edilmiştir. Çalışmada aynı zamanda orta gelir tuzağında olmayan ABD, Almanya, Fransa, İngiltere, İtalya, Japonya ve Kanada için de aynı test yapılarak orta gelir tuzağında olan ve olmayan ülkelerde beşeri sermayenin ekonomik büyümedeki rolü karşılaştırılmak istenmiştir. Çalışmadan elde edilen ampirik bulgulara göre, orta gelir tuzağında olmayan seçilen gelişmiş ülkelerde ekonomik büyüme ile beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi arasında çift yönlü bir nedensellik ilişkisi mevcuttur. Bu bulgu söz konusu ülkelerde beşeri sermaye faktörünün ekonomik büyümedeki etkisini göstermesi açısından oldukça önemlidir. Diğer yandan orta gelir tuzağında olan kırılgan beşli ülkelerinde de ise ekonomik büyüme ile beşeri sermaye endeksi ve eğitim endeksi arasında herhangi bir nedensellik ilişkisi görülmemiştir. Bu bulguya dayanarak, kişi başına gelirin arttırılmasında ve orta gelir tuzağında olan ülkeler özelinde orta gelir tuzağından çıkış

sürecinde, beşeri sermayenin üzerinde durulması gereken değişkenlerden biri olduğu söylenebilmektedir. İçsel büyüme teorilerinde önemle vurgulandığı gibi, beşeri sermayeye yapılacak yatırımlar ülkelerin uzun vadede büyüme süreçlerine olumlu katkılar yapacak ve orta gelir tuzağında olan söz konusu beş ülkenin üst gelir gruplarında yer almalarını da kolaylaştıracaktır.

KAYNAKÇA

- Akel, V. (2015). “Kırılgan Beşli Ülkelerinin Hisse Senedi Piyasaları Arasındaki Eşbütünleşme Analizi”, Uluslararası Yönetim İktisat ve İşletme Dergisi, 11 (25): 75-96.
- Ali, M., Egbetokun, A. ve Memon, M. H. (2018) “Human Capital, Social Capabilities and Economic Growth”, *Economies*, 6(2): 1-18.
- Arabi, K. A. M. ve Abdalla, S. Z. S. (2013) “The Impact of Human Capital on Economic Growth: Empirical Evidence from Sudan”, *Research in World Economy*, 4(2): 43-53.
- Bozkurt, K. ve Balmumcu, Ö. (2018) “Beşeri Sermaye ve Ekonomik Büyüme: Gelişmekte Olan Ülkeler İçin Bir Panel Veri Analizi” *Uluslararası İktisadi ve İdari İncelemeler Dergisi*, Prof. Dr. Harun Terzi Özel Sayısı: 391-406.
- Daşçı, E. ve Cemaloğlu, N. (2018) “Beşeri Sermayeye Yapılan Harcamaların Ekonomik Büyümeye Etkisi: Panel Var Analizi”, *Abant İzzet Baysal Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 18(2): 1-16.
- Daşdemir, A. M. (2008) “AB Üyesi Ülkelerde Beşeri Sermaye ve Ekonomik Büyüme İlişkisi: Panel Veri Analizi”, *Dokuz Eylül Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Ekonometri Anabilim Dalı, Yüksek Lisans Tezi*, İzmir.
- Dünya Bankası (2018) “Ekonomik Göstergeler” <http://databank.worldbank.org/data/home.aspx>. (17.09.2018)
- Enders, W. (1995) “Applied Econometric Time Series”, John Willey and Song, Inc. 4th Edition, Wiley Series in Probability and Statistics.
- Freire-Seren, M. J. (2001). “Human Capital Accumulation and Economic Growth”, *Investigaciones Economicas*, XXV(3): 585-602.
- Granger, C. W. J. (1969) “Investigating Causal Relations by Econometric Models and Cross-Spectral Methods”, *Econometrica*, 37: 424-438.
- Gill I. ve Kharas, H. (2007) “An East Asian Renaissance: Ideas for Economic Growth”, *The International Bank for Reconstruction and Development / The World Bank*.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Johansen, S. (1995) "Likelihood Based Inference in Cointegrated Vector Autoregressive Models", Oxford University Press, New York.
- Kar, M. ve Ağır, H. (2006) "Türkiye'de Beşeri Sermaye ve Ekonomik Büyüme İlişkisi: Eşbütünlük Yaklaşımı İle Nedensellik Testi 1926-1994", SÜ İİBF Sosyal ve Ekonomik Araştırmalar Dergisi, 11: 51-68.
- Keskin, A. (2011) "Ekonomik Kalkınmada Beşeri Sermayenin Rolü ve Türkiye" Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 25(3-4): 125-153.
- Kibritçiöğlü, A. (1998). "İktisadi Büyümenin Belirleyicileri ve Yeni Büyüme Modellerinde Sermayenin Yeri", Ankara Üniversitesi Siyasal Bilgiler Fakültesi Dergisi, 53 (1-4): 207-230.
- Lucas, R. E. (1989). "On the Mechanics on Economic Development", Journal of Monetary Economics, 22: 3-42.
- Manga, M., Bal, H., Algan, N. ve Kandır, E. D. (2015) "Beşeri Sermaye, Fiziksel Sermaye ve Ekonomik Büyüme İlişkisi: BRICS Ülkeleri ve Türkiye Örneği". Ç. Ü. Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, 24(1): 45-60.
- Ogunleye, O. O., Owolabi, O. A., Sanyaolu, O. A. ve Lawal, O. O. (2017) "Human Capital Development and Economic Growth in Nigeria", IJRDO-Journal of Business Management, 3(8): 17-37.
- Pamuk, M. ve Bektaş, H. (2014) "Türkiye'de Eğitim Harcamaları ve Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişki: ARDL Sınır Testi Yaklaşımı", Siyaset, Ekonomi ve Yönetim Araştırmaları Dergisi, 2(2): 77-90.
- Pelinescu, E. (2015) "The Impact of Human Capital on Economic Growth", Procedia Economics and Finance, 22:184-190.
- Romer, P. M. (1989) "Human Capital and Growth: Theory and Evidence", NBER Working Paper Series, WP, 3173.
- Romer, P. M. (1986) "Increasing Returns and Long Run Growth", The Journal of Political Economy, 94 (5): 1002-1037.
- Şimşek, M. ve Kadılar, C. (2010). "Türkiye'de Beşeri Sermaye, İhracat ve Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişkinin Nedensellik Analizi", C.Ü. İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, 11 (1): 115-140.
- Tho, T.V. (2013) "The Middle Income Trap: Issues for Members of the Association of Southeast Asian Nations", ADBI Working Paper Series, No:421, Asian Development Bank Institute, Tokyo, Japan.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Topallı, N. (2017) “Beşeri Sermaye ve Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişki: Türkiye Örneği”, Ömer Halisdemir Üniversitesi İİBF Dergisi, 10(2): 129-140.

UNDP (2018) “Birleşmiş Milletler Kalkınma Programı”.
<http://www.undp.org/content/undp/en/home/blog/2018.html> (17.09.2018)

Yülek, M. (1997) “İçsel Büyüme Teorileri, Gelişmekte Olan Ülkeler ve Kamu Politikaları Üzerine”, Hazine Dergisi, Nisan-1997, 6: 1-15.



**FİNANSAL ORANLARIN ÖNEM DÜZEYLERİNİN HESAPLANMASINDA AHP VE BWM
YÖNTEMLERİNİN KARŞILAŞTIRILMASI¹**

Ömer Faruk RENÇBER*

ÖZET

Karar verme süreci; alternatifler içerisinde optimal olanı tercih etmek olarak tanımlanmaktadır. Bu kapsamda süreç içerisinde, karar vericiye nicel anlamda kriterleri karşılaştırma olanağı sağlayan birçok çok kriterli karar verme (ÇKKV) teknikleri geliştirilmiştir.

Literatürde, finansal değerlendirme konularında yapılan çalışmalarda Promethee, Topsis, Electre veya VIKOR gibi ÇKKV yöntemlerinin sıklıkla kullanıldığı ve bunların neredeyse tamamında oranların önem düzeylerinin önceden belirlenmesi gerektiği görülmektedir. Bu gibi durumlarda ağırlıkların uzman yardımıyla veya Analitik Hiyerarşi Süreci (AHP) yöntemi ile belirlendiği dikkat çekmektedir. BWM yöntemi ise AHP'ye alternatif olarak 2015 yılında Rezeai tarafından geliştirilmiştir.

Bu çalışmada, finansal oranların önem düzeylerinin belirlenmesinde AHP ve BWM yöntemlerinin karşılaştırmalı olarak incelenmesi amaçlanmaktadır. Bu doğrultuda, uzmanlara sorulan anketler aracılığıyla finansal oranlar; likidite, faaliyet, finansal yapı, karlılık ve performans oranları öncelikle kendi aralarında daha sonra da her oran kendi içinde her iki yönteme göre karşılaştırılmıştır. Sonuç olarak; duyarlılık oranlarına göre AHP'nin daha iyi sonuçlar verdiği görülse de BWM yönteminin az veri ile benzer değerlendirmeyi yaptığı bulgusuna ulaşılmıştır.

Anahtar Kelimeler: Finansal Oranlar, AHP, BWM

ABSTRACT

Decision-making process; it is defined as preferring the optimal among alternatives. In this context, many multi-criteria decision-making techniques have been developed that allow decision-makers to compare criteria in quantitative terms.

In the literature, the methods used in financial evaluation subjects such as Promethee, Topsis, Electre or VIKOR are frequently used and the importance levels of these ratios should be determined in advance. In such cases, it is noteworthy that the weights are determined individually or by the Analytical Hierarchy Process (AHP) method.

¹ Bu çalışma Çukurova Üniversitesi Bilimsel Araştırma Projeleri Birimi tarafından SBA-2018-10851 numaralı proje ile desteklenmiştir.

* Öğr. Gör. Dr., Çukurova Üniversitesi, Kozan MYO, ofrencber@cu.edu.tr, ORCID: 0000-0001-8020-2750

In this study, it is aimed to apply AHP and BWM methods comparatively in determining the importance levels of financial ratios. In this respect, the financial ratios through the questionnaires asked to the experts; The ratios of liquidity, activity, financial structure, profitability and performance was compared among each other and then each ratio will be compared according to both methods. As a result; Although it was observed that AHP gave better results according to sensitivity rates, it was found that BWM method performed similar evaluation with little dataset.

Keywords: *Finansal Oranlar, AHP, BWM*

1.GİRİŞ

Doğadaki bütün canlılar hayatlarının herhangi bir zaman diliminde önemli ya da önemsiz birçok sorunda karar verme problemi ile karşılaşmaktadır. Bu kararlar canlının faaliyetlerini ve yaşamını etkilemektedir. Karar verme sürecinin kantitatif incelenme süreci şu şekilde sıralanabilir; karar probleminin tanımlanması, problemin formüle edilmesi, model kurma, bilgi derleme, modelin çözümü, modelin geçerliliğinin ve duyarlılığının incelenmesi, sonuçların yorumlanması, karar verme ve kontrol etmedir(Rençber, 2010; Kazan, 2010).

Karar verme süreci teknik anlamda çok kriterli karar verme problemleri ile incelenmektedir. Çok kriterli karar verme yöntemleri karar teorisi ve yöneylem araştırmaları için oldukça büyük öneme sahiptir. Özellikle bu yöntemler, alternatiflerin içerisinde en iyisinin belirlenmesi ve kriterlerin önem düzeylerinin belirlenebilmesi için kullanılmaktadır. Bir problemin ÇKKV süreci ile çözülmesinde yer alan aşamalar şu şekildedir; amaçların belirlenmesi, kriterlerin oluşturulması, alternatiflerin belirlenmesi ve genel olarak değerlendirme ve karar vermedir.

Günümüzde en çok kullanılan ve bilinen metotların başında Analitik Hiyerarşi Proses (AHP), Analitik Ağ Süreci (ANP), TOPSİS, ELECTRE, Gri İlişkisel Analiz (GIA), VIKOR ve PROMETHEE yöntemleri gelmektedir. Bu yöntemlerle birlikte zamanla yeni teknikler de üretilmektedir. BWM yöntemi de 2015 yılında Rezeai tarafından AHP gibi ÇKKV tekniklerine alternatif olarak geliştirilmiştir.

ÇKKV yöntemleri kendi içerisinde kullandıkları yöntemsel araçlar yönleriyle farklılaşmaktadır. Örneğin, AHP yöntemi anket vasıtasıyla kriterlerin ikili karşılaştırılması; TOPSİS alternatiflerin pozitif ideal çözüme olan yakınlığa göre incelenmesi; GIA kriterleri en iyi referans değere olan yakınlığa göre incelenmesi mantıklarına dayanmaktadırlar.

Bu çalışmada AHP ve BWM metotlarının karşılaştırılması amaçlanmaktadır. Teorik olarak yapılan karşılaştırmaların yanı sıra finansal oranların ağırlıklarının tespit edilmesi sorununun çözümünde de yöntemler uygulamalı olarak karşılaştırılmıştır. Bu nedenle öncelikle literatür incelemesinin ardından yöntemler teorik olarak anlatılmıştır. Daha sonra çalışmada kullanılan değişkenler ve hesaplama

şekillerine yer verilmiş ve yöntemler ayrı ayrı uygulanmıştır. Elde edilen sonuçlara ise bulguların karşılaştırılması ve sonuç bölümlerinde yer verilmiştir.

2.LİTERATÜR İNCELEMESİ

Literatürde finansal sorunlara ilişkin yapılan çalışmalarda ÇKKV tekniklerinin kullanımı ile birlikte ağırlık belirleme işlemleri de yapılmaktadır. Finansal oranların ağırlık ve önem düzeylerinin belirlenmesi konusunda farklı uygulamalar bulunmakta olup, örnek olarak bu çalışmalardan bazıları tablodaki gibidir.

Tablo 1. Finansal Çalışmalardan Bazıları İçin Örnek Ağırlık Hesaplama Yöntemleri

| Yazarlar | İncelenen Konu | Ağırlık Hesaplama Yöntemi |
|--|---|--|
| <i>Bakırçı, Shiraz ve Sattary (2014)</i> | Finansal performans analizi konusunda TOPSİS uygulaması | Shannon Entropisi Yöntemi |
| <i>Demireli (2010)</i> | Kamu bankaları için performans ölçümü | Yöntem kullanmamış ve bireysel olarak belirlemiştir. |
| <i>Ömürbek ve Kınay (2013)</i> | Havacılık sektörü için finansal performans ölçümü | Nitel görüşme ile oranların ağırlıklarını belirlemiştir. |
| <i>Akbulut ve Rençber (2015)</i> | Finansal performans ölçümü | Finansal oranların toplam değer içindeki payına göre belirlemiştir. |
| <i>Erturul ve Karakaşoğlu (2009)</i> | Çimento sektör şirketleri için finansal performans ölçümü | Bulanık AHP Yöntemi |
| <i>Yayar ve Baykara (2012)</i> | Bankaları için etkinlik ve verimlilik ölçümü | Her kritere bir puan vererek toplam puan içerisindeki paya göre belirlemiştir. |
| <i>Karaoğlu ve Şahin (2018)</i> | XKMYA İşletmeleri için finansal performans ölçümü | AHP Yöntemi |
| <i>Bülbül ve Köse (2016)</i> | Sigorta şirketleri için finansal performans | Finansal oranların ağırlıkları eşit olarak almışlardır. |
| <i>Mandic vd (2014)</i> | Bankaların finansal performans ölçümü | Bulanık AHP Yöntemi |
| <i>Liu vd. (2017)</i> | Risk Değerlendirme | Entropi |
| <i>Eshtaiwi vd. (2017)</i> | Taşımacılık alanındaki başarı kriterlerinin önem düzeyinin ölçümü | AHP |
| <i>Alimohammedlou ve Bonyani (2017)</i> | Finansal Performans | BWM |

AHP yönteminin uygulandığı bazı çalışmalar ve bunlara ilişkin kullanım nedenleri aşağıda yer alan tablo 2'deki gibidir.

Tablo 2. AHP Yönteminin Uygulandığı Bazı Örnek Çalışmalar

| Yazarlar (Yıl) | Yöntemin Kullanım Amacı |
|--------------------------------------|---|
| <i>Tayyar vd. (2014)</i> | Finansal performans ölçümleri için Gri İlişkisel Analiz yönteminin uygulamasında kullanılan finansal oranların ağırlıklarının tespit edilmesi |
| <i>Gergin ve Baki (2015)</i> | Şirketlerin lojistik performanslarının ölçümü konusunda VIKOR analizinin uygulanabilmesi için kriterlerin ağırlıklarının belirlenmesi |
| <i>Aydın ve Eren (2018)</i> | Savunma sanayiinde tedarikçi Seçimi |
| <i>Görener ve Sabuncuoğlu (2016)</i> | İnşaat işleri için tedarikçi seçimi konusunda Bulanık TOPSIS yönteminin uygulanabilmesi nedeniyle ağırlık tespiti |
| <i>Demircanlı ve Kundakçı (2015)</i> | VIKOR yöntemi ile futbolcu transferi için optimum kişinin seçimi |
| <i>Çalışkan ve Eren (2016)</i> | Bankaların performanslarının ölçümü için PROMETHEE yönteminin kullanımında değişkenlerin ağırlıklarının belirlenmesi |

BWM yöntemi yeni bir yöntem olmasına rağmen literatürde yoğun olarak kullanıldığı görülmektedir. Örnek olarak BWM yönteminin uygulandığı bazı çalışmalara tablo 3’de yer verilmiştir. Aynı zamanda yöntemin kullanım alanlarına ilişkin literatür incelemesi Rezaei tarafından yayımlanmıştır(BWM Bibliographical Database,2018).

Tablo 3. BWM Yönteminin Uygulandığı Bazı Örnek Çalışmalar

| Yazarlar (Yıl) | Kullanım Alanı |
|--|---|
| Abadi vd. (2018) | Medikal turizm geliştirime stratejilerinin belirlenmesi |
| Aboutorab vd. (2018) | Tedarikçi seçimi |
| Amoozad vd. (2018) | COPRAS yönteminde kriterlerin ağırlık belirlenmesi amacıyla bulanık BWM kullanılmıştır |
| Gupta ve Barua (2017) | Bulanık TOPSIS yöntemi ile tedarikçi seçim probleminin çözümü için kriterlerin ağırlıklarının tespiti |
| Raj ve Srivastava (2018) | Uçak üretim firmaları için performans ölçümü |
| Rezaei vd. (2018) | Tedarik zinciri yöntem organizasyonu |
| Yodallahi, Kazemi ve Ranjbarian (2018) | Bankalarda hizmet kalitesi ölçümünde önemli faktörlerin belirlenmesi |

3.YÖNTEMLER

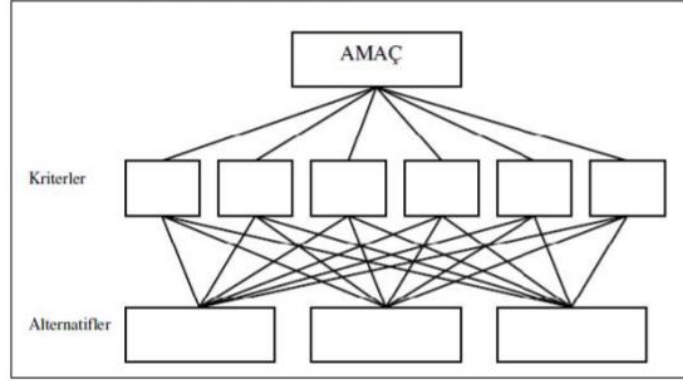
Bu çalışmada kriterlerin (finansal oranların) önem düzeylerinin belirlenebilmesi için Analitik Hiyerarşi Süreci (AHP) ve En İyi-En Kötü Metodu (BWM) kullanılmıştır. Bu bölümde ise yöntemlerin teorik bilgilerine yer verilmiştir.

3.1.Analitik Hiyerarşi Süreci (AHP)

Analitik Hiyerarşi Süreci (Analytic Hierarchy Process-AHP) yöntemi, ilk olarak 1968 yılında Myers ve Albert tarafından ortaya atılmış ve 1977’de Satty tarafından model olarak geliştirilerek karar verme problemlerinde kullanılabilir hale getirilmiştir.

AHP yöntemi, problemleri hiyerarşik olarak ikili karşılaştırma mantığıyla ele almaktadır. Özellikle kriterlerin ağırlıklarının belirlenmesi veya alternatiflerin sıralanması amacıyla kullanılmaktadır. Bunun için yöntemin uygulaması aşamasında öncelikle kriterler ve alternatiflerin bulunduğu model oluşturulur. Modelin içerisinde ana kriterler ve buna bağlı olarak alt kriterler ile alternatifler yer alır. Örnek olarak üç alternatifli altı kriterli bir karar probleminin hiyerarşik modeli şekil 1’deki gibidir (Ömürbek, Helvacıoğlu ve Üstündağ, 2013).

Şekil 1. AHP Yöntemine Göre Hiyerarşik Yapı



Model oluşturulduktan sonra çalışmanın veri setinin oluşturulması amacıyla ikili karşılaştırma mantığını içeren anket formu hazırlanmalıdır. Bu çalışma için hazırlanan ve ana kriterleri içeren örnek anket formuna Ek 1’de yer verilmiştir.

AHP yönteminde kriterlerin önem düzeyi belirlenirken her satırın toplamı alınıp her toplam değeri söz konusu toplamın toplamına bölünür. Elde edilen ilk vektörün elemanı ilk faaliyetin göreceli önemini, ikincisi ikinci faaliyetin göreceli önemini verir. Kriterlerin ağırlıklarının belirlenmesinin ardından normalleştirilen matriste her satırın ortalaması alınarak o alternatifin öncelik düzeyi belirlenmiş olur. Daha sonra elde edilen sıralamanın ne düzeyde tutarlı olduğunun tespit edilmesi gerekmektedir. Bunun için aşağıdaki denklem kullanılır;

$$\text{Tutarlılık Göstergesi} = \frac{\lambda_{\max} - n}{n - 1} \quad (1)$$

$$\text{Tutarlılık oranı} = \frac{\text{Tutarlılık Göstergesi}}{\text{Rassallık Göstergesi}} \quad (2)$$

Denklemden belirtilen rassallık göstergesi ise şu şekildedir;

Tablo 4. Rassallık Göstergesi Değerleri

| n | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|----|---|---|------|-----|------|------|------|------|------|
| RG | 0 | 0 | 0,58 | 0,9 | 1,12 | 1,24 | 1,32 | 1,41 | 1,45 |

Tutarlılık oranı, aynı zamanda anketi dolduran kişinin cevaplarının ne düzeyde tutarlı olduğunun bir göstergesidir. Bu değer genellikle %10’un altında olması beklenen bir durumdur. AHP yöntemi ile her bir anket formu ile elde edilen sıralamanın genel kanaati yansıtabilmesi için tek bir sıralamaya indirgenmesi gerekmektedir. Bu aşamada genellikle her bir alternatif için elde edilen sıralama skorlarının geometrik ortalaması alınmakta ve nihai sıralama yapılmaktadır.

3.2.En İyi En Kötü Metodu (BWM)

En iyi en kötü metodu (BWM) 2015 yılında Jafar Rezaei tarafından geliştirilmiştir. Yöntem her bir kriteri diğerleri ile tek tek karşılaştırmak yerine en iyi (en önemli) ve en kötü (en az önemli) kriterlere göre karşılaştırma mantığına dayanmaktadır. Bu sayede daha az veri ile daha tutarlı sonuçlar bulunabileceği düşüncesi ile geliştirilmiştir. BWM yönteminin uygulama aşamaları şu şekildedir;

Adım 1: Karar matrisinin oluşturulması

Adım 2: En önemli ve en az önemli (en önemsiz) kriterlerin belirlenmesi

Adım 3: Her bir kriter ile en önemli kriteri karşılaştırarak 1 ile 9 arasında bir değerlendirme yapılır. Bu aşamada Best-Others (A_B) olarak ifade edilen bir vektör elde edilmektedir. İkili karşılaştırmada verilecek puanların anlamları yine AHP yöntemindeki gibidir. A_B vektörü şu şekilde ifade edilmektedir;

$$A_B = (a_{b1}, a_{b2}, \dots, \dots, a_{bn}) \quad (3)$$

A_B vektöründeki her bir a_{bj} en önemli kriter ile j . kriter arasındaki karşılaştırma puanını ifade etmektedir. Aynı zamanda burada a_{bb} ifadesinin karşılığı 1 olacaktır. Çünkü burada en önemli kriter kendisiyle karşılaştırılmaktadır.

Adım 4: Bir önceki adıma benzer olarak en önemsiz kriter belirlenir ve diğer kriterler ile karşılaştırılır. Bu aşamada elde edilecek olan vektör şu şekildedir;

$$A_W = (a_{w1}, a_{w2}, \dots, \dots, a_{wn})^T \quad (4)$$

A_W vektöründeki her bir a_{wj} en önemli kriter ile j . kriter arasındaki karşılaştırma puanını ifade etmektedir. Benzer şekilde burada a_{ww} ifadesinin karşılığı 1 olacaktır. Çünkü burada en önemsiz kriter kendisiyle karşılaştırılmaktadır.

Adım 5: Optimal ağırlıklar hesaplanır. Bunun için aşağıdaki maximin modeli kullanılmaktadır;

$$\min \max_j \{ |w_B - a_{Bj} x w_j|, |w_j - a_{jw} x w_w| \} \quad (5)$$

Özel olarak şu şartlar sağlanmalıdır;

$$\sum_j w_j = 1 \quad (6)$$

$$w_j \geq 0, \text{ bütün } j \text{ için} \quad (7)$$

Yukarıda bahsedilen maximin modeli doğrusal programlama modeline göre şu şekilde olmaktadır;

\min_{ξ^L} şartıyla,

$$|w_B - a_{Bj} x w_j| \leq \xi^L \quad (8)$$

$$|w_j - a_{jw} x w_w| \leq \xi^L \quad (9)$$

$$\sum_j w_j = 1 \quad (10)$$

$$w_j \geq 0, \text{ bütün } j \text{ için} \quad (11)$$

BWM yöntemi uygulamasının ardından yöntemin duyarlılığın hesaplanması gerekmektedir. Doğrusal programlama türüne göre yapılan hesaplamalarda ξ^* değeri analizin duyarlılığını göstermektedir. Bu değer 0'a yakın olması tutarlılığın yüksek olduğu anlamına gelmektedir ve mümkün olduğunda minimum olması arzu edilmektedir.

Ağırlıkların belirlenmesinin ardından alternatiflerin sıralanması için normalize edilen karar matrisindeki alternatiflere ait değerlerin ağırlıklı ortalaması alınır. Bu aşamadaki normalizasyon işlemi şu denklem ile yapılır;

$$x_{ij}^{norm} = \begin{cases} \frac{x_{ij}}{\max(x_{ij})}, & \text{eğer } x \text{ pozitif yönlü ise (kârlılık gibi)} \\ 1 - \frac{x_{ij}}{\max(x_{ij})}, & \text{eğer } x \text{ negatif yönlü ise (maliyet gibi)} \end{cases} \quad (12)$$

Burada yer alan parçalı fonksiyona göre nihai skorlar üretilir ve sıralama yapılır.

4. UYGULAMA

4.1. Çalışmanın Amacı ve Kapsamı

Çalışmada çok kriterli karar verme problemlerinde değişkenlerin ağırlıklarının ve alternatiflerin sıralanmasının belirlenmesinde kullanılan AHP ve BWM metotlarının uygulamalı olarak karşılaştırılması amaçlanmaktadır. Bu doğrultuda finansal performans, karlılık veya benzeri problemlerde sıklıkla kullanılan finansal oranların ağırlık ve önem düzeylerinin belirlenmesi üzerine örnek uygulama yapılmıştır.

Çalışmanın veri seti, uzmanlar tarafından doldurulan anketler vasıtasıyla elde edilmiştir. Bu nedenle her iki yönetime göre oluşturulan anket formları akademik anlamda finans alanında uzman yedi kişi tarafından doldurulmuştur. Aynı zamanda çalışmada yöntemlerin analizleri de her bir uzman için her iki yönetime göre ayrı ayrı yapılmıştır. Daha sonra elde edilen sonuçlar karşılaştırılmıştır.

4.2. Kullanılan Değişkenler

Çalışmada kullanılan değişkenler finans alanında uzman akademisyenler aracılığıyla belirlenmiştir. Buna göre çalışma kapsamında kullanılan değişkenler tablo 2'deki gibidir.

Tablo 5. Çalışmada Kullanılan Ana ve Alt Kriterler

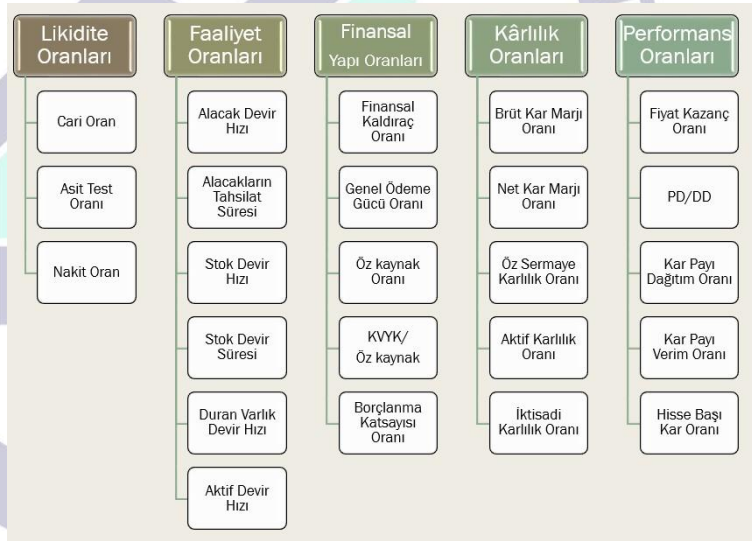
| Ana Kriterler | Alt Kriterler | Hesaplama Şekli |
|------------------------|-----------------------------|---|
| Likidite Oranları | Cari Oran | Dönen Varlıklar / Kısa Vadeli Borç (KVB) |
| | Asit Test Oranı | (Dönen Varlıklar – Stoklar) / KVB |
| | Nakit Oran | (Hazır Değerler + Menkul Kıymetler) / KVB |
| Faaliyet Oranları | Alacak Devir Hızı (ADH) | Net Satışlar / Ortalama Ticari Alacaklar |
| | Alacakların Tahsilat Süresi | 360 veya 365 / ADH |
| | Stok Devir Hızı (SDH) | Net Satışlar / Ortalama Stoklar |
| | Stok Devir Süresi | 360 veya 365 / SDH |
| | Duran Varlık Devir Hızı | Net Satışlar / Duran Varlık Toplamı |
| Finansal Yapı Oranları | Aktif Devir Hızı | Net Satışlar / Aktif Toplamı |
| | Finansal Kaldıraç | (KVB + UVB) / Aktif Toplamı |
| | Genel Ödeme Gücü | Aktif Toplamı / (KVB+UVB) |
| | Öz Kaynak | Öz Kaynak Toplamı / Aktif Toplamı |

| | | |
|----------------------------|-----------------------------|--|
| | KVYK/Öz kaynak | KVB / Öz Kaynak Toplamı |
| | Borçlanma Katsayısı | (KVB + UVB) / Öz Kaynak Toplamı |
| Kârlılık Oranları | Brüt Kâr Marjı | Brüt Satış Karı / Net Satışlar |
| | Net Kâr Marjı | Net Kar / Net Satışlar |
| | Öz sermaye Karlılığı | Net Kar / Öz kaynaklar Toplamı |
| | İktisadi Karlılık | FVÖK / Toplam Varlık |
| | Aktif Kârlılık | Net Kar / Toplam Aktif |
| Performans Oranları | Fiyat Kazanç | Hisse Başı Piyasa Fiyatı / Hisse Başı Kazanç |
| | Piyasa Değeri/Defter Değeri | Hisse Başı Piyasa Değeri / Hisse Başı Defter Değeri |
| | Kar payı Dağıtım | Hisse Başına Dağıtılan Kar Payı / Hisse Başına Düşen |
| | Kar payı Verim Oranı | Toplam Ödenen Temettü / Şirketin Piyasa Değeri |
| | Hisse Başı Kar | Net Kar / Hisse Senedi Sayısı |

Kaynak: Şamiloğlu & Akgün, 2015: 424-443.

Tablo 5’de görüldüğü üzere çalışmada, literatürde sıklıkla kullanılan hemen hemen bütün finansal oranlar dikkate alınmıştır. Bu sayede çalışmanın finansal performans, karlılık veya genel olarak analiz konularında ağırlık belirlenmesi konusunda kaynak bir çalışma olabileceği düşünülmektedir. Aynı zamanda Tablo 5’de görülen değişkenler dikkate alındığı durumda çalışmanın modeli Şekil 2’deki gibi olmaktadır.

Şekil 2. Çalışmanın Değişkenlerini İçeren Model



4.3.AHP Uygulaması

AHP yöntemi kriterlerin önem düzeylerinin belirlenmesi ve alternatifler içerisinde en iyi seçeneğin tespit edilmesi amacıyla kullanılmaktadır. Bu çalışmada alternatiflerin değerlendirilmesinden ziyade kriterlerin önem düzeyine göre sıralanması amaçlanmıştır. Bu nedenle çalışmada kullanılan ana ve alt kriterler kendi içerisinde karşılaştırılmıştır. Bunun için hazırlanan anket formunun örnek hali Ek 1’deki gibidir. Yöntemin uygulaması neticesinde ana kriterlere istinaden elde edilen skorlar tablo 6’daki gibidir.

Tablo 6. Ana Kriterlere İlişkin AHP Sonuçları

| Ana Kriterler | U1 | U2 | U3 | U4 | U5 | U6 | U7 | ORT | STD_ORT |
|----------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| Faaliyet | 0,04 | 0,06 | 0,07 | 0,03 | 0,20 | 0,22 | 0,03 | 0,07 | 0,08 |
| Finansal Yapı | 0,17 | 0,16 | 0,08 | 0,09 | 0,13 | 0,15 | 0,06 | 0,11 | 0,128 |
| Karlılık | 0,22 | 0,09 | 0,02 | 0,13 | 0,06 | 0,26 | 0,11 | 0,10 | 0,116 |
| Likidite | 0,16 | 0,38 | 0,24 | 0,40 | 0,29 | 0,02 | 0,24 | 0,18 | 0,209 |
| Performans | 0,43 | 0,32 | 0,59 | 0,35 | 0,32 | 0,35 | 0,56 | 0,40 | 0,468 |
| Duyarlılık | 0,05 | 0,02 | 0,25 | 0,07 | 0,37 | 1,07 | 0,31 | 0,31 | |

Tablo 6'da yer alan ana kriterlere ait AHP yönteminin uygulama sonuçları her uzman tarafından verilen cevaplara istinaden ayrı ayrı elde edilmiştir. Daha sonra kişi bazlı sonuçların geometrik ortalaması alınarak kendi içinde değerlendirilmiştir. Ancak ağırlıkların toplamalarının 1'e eşit olması gerektiğinden kriterlerin ortalama önem düzeyleri toplam ortalamaya bölünmüştür. Bu şekilde standart ağırlıklara dayanarak nihai sonuç elde edilmiştir. Buna göre, ana kriterler içerisinde performans oranlarının en önemli; diğer oranların ise önem düzeyine göre sırasıyla likidite, finansal yapı, kârlılık ve faaliyet oranları şeklinde olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Duyarlılık oranı verilen cevapların tutarsızlığını ifade etmektedir. Bu değer en iyi analiz durumu için sifıra yakın olması beklenmektedir. Elde edilen sonuçlara göre ise duyarlılık oranları 0,05 ile 1,07 arasında değişmektedir. Bu farklılıkların uzmanların tercih ve bilgi düzeylerinden kaynaklandığı ifade edilebilir. Ortalama duyarlılık skoru ise 0,31 olarak bulunmuştur. Alt kriterler benzer şekilde değerlendirildiği durumda elde edilen sonuçlar tablo 7'deki gibi olmaktadır.

Tablo 7. Alt Kriterlere ait AHP Uygulama Sonucu

| | Alt Kriterler | U1 | U2 | U3 | U4 | U5 | U6 | U7 | ORT | STD_ORT |
|-------------------|-------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| Likidite | Cari Oran | 0,11 | 0,43 | 0,06 | 0,67 | 0,20 | 0,06 | 0,06 | 0,22 | 0,18 |
| | Asit Test Oranı | 0,64 | 0,43 | 0,18 | 0,08 | 0,31 | 0,20 | 0,18 | 0,29 | 0,30 |
| | Nakit Oran | 0,26 | 0,14 | 0,76 | 0,25 | 0,49 | 0,74 | 0,76 | 0,49 | 0,52 |
| | Duyarlılık | 0,04 | 0,00 | 0,41 | 0,16 | 0,05 | 0,42 | 0,41 | 0,21 | |
| Faaliyet | Alacak Devir Hızı | 0,04 | 0,20 | 0,10 | 0,05 | 0,13 | 0,01 | 0,14 | 0,09 | 0,08 |
| | Alacak Tahsilat Süresi | 0,07 | 0,08 | 0,10 | 0,04 | 0,13 | 0,13 | 0,20 | 0,11 | 0,11 |
| | Stok Devir Hızı | 0,24 | 0,20 | 0,10 | 0,09 | 0,30 | 0,12 | 0,16 | 0,17 | 0,18 |
| | Stok Devir Süresi | 0,38 | 0,20 | 0,10 | 0,09 | 0,26 | 0,183 | 0,124 | 0,19 | 0,20 |
| | Duran Varlık Devir Hızı | 0,09 | 0,11 | 0,03 | 0,21 | 0,08 | 0,41 | 0,13 | 0,15 | 0,13 |
| | Aktif Devir Hızı | 0,17 | 0,23 | 0,57 | 0,53 | 0,11 | 0,15 | 0,25 | 0,29 | 0,29 |
| Finansal yapı | Duyarlılık | 0,22 | 0,01 | 0,08 | 0,10 | 0,06 | 0,84 | 1,24 | 0,36 | |
| | Finansal Kaldıraç | 0,64 | 0,24 | 0,16 | 0,22 | 0,19 | 0,12 | 0,18 | 0,25 | 0,25 |
| | Genel Ödeme Gücü | 0,06 | 0,24 | 0,51 | 0,16 | 0,25 | 0,10 | 0,13 | 0,21 | 0,19 |
| | Öz kaynak | 0,17 | 0,11 | 0,17 | 0,33 | 0,15 | 0,29 | 0,27 | 0,21 | 0,23 |
| | KVYK/Öz kaynak | 0,05 | 0,11 | 0,05 | 0,07 | 0,12 | 0,26 | 0,21 | 0,12 | 0,12 |
| | Borçlanma Katsayısı | 0,09 | 0,29 | 0,13 | 0,22 | 0,30 | 0,23 | 0,21 | 0,21 | 0,22 |
| Kârlılık | Duyarlılık | 0,11 | 0,01 | 0,11 | 0,24 | 0,06 | 1,40 | 1,57 | 0,50 | |
| | Brüt Kar Marjı | 0,03 | 0,14 | 0,05 | 0,05 | 0,07 | 0,39 | 0,14 | 0,12 | 0,10 |
| | Net Kar Marjı | 0,17 | 0,34 | 0,32 | 0,40 | 0,15 | 0,27 | 0,17 | 0,26 | 0,27 |
| | Öz sermaye Karlılığı | 0,41 | 0,17 | 0,33 | 0,31 | 0,26 | 0,06 | 0,39 | 0,28 | 0,26 |
| | İktisadi Karlılık | 0,18 | 0,23 | 0,22 | 0,16 | 0,41 | 0,14 | 0,19 | 0,22 | 0,23 |
| | Aktif Karlılık | 0,21 | 0,12 | 0,08 | 0,08 | 0,12 | 0,39 | 0,11 | 0,16 | 0,15 |
| Duyarlılık | 0,26 | 0,13 | 0,12 | 0,17 | 0,09 | 0,26 | 1,15 | 0,31 | | |

| Performans | | | | | | | | | | |
|-------------------|--------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | Fiyat Kazanç | 0,53 | 0,26 | 0,45 | 0,25 | 0,13 | 0,25 | 0,10 | 0,28 | 0,29 |
| PD/DD | 0,20 | 0,26 | 0,10 | 0,40 | 0,25 | 0,55 | 0,59 | 0,33 | 0,34 | |
| Kar payı Dağıtım | 0,05 | 0,10 | 0,19 | 0,07 | 0,23 | 0,12 | 0,05 | 0,12 | 0,12 | |
| Kar payı Verim | 0,11 | 0,10 | 0,19 | 0,10 | 0,13 | 0,05 | 0,02 | 0,10 | 0,10 | |
| Hisse Başı Kar | 0,11 | 0,29 | 0,07 | 0,18 | 0,26 | 0,03 | 0,24 | 0,17 | 0,15 | |
| Duyarlılık | 0,11 | 0,01 | 0,08 | 0,18 | 0,10 | 0,38 | 0,37 | 0,18 | 0,18 | |

Tablo 7’de görüldüğü üzere yedi uzmanın vermiş oldukları cevaplara dikkat edildiği durumda likidite oranlarından nakit oran, faaliyet oranlarından aktif devir hızı, finansal yapı oranlarından finansal kaldıraç, kârlılık oranlarından net kâr marjı ve performans oranlarından piyasa değeri/ defter değerinin en önemli oldukları sonucuna ulaşılmıştır. Bununla birlikte her bir ana kriter altında bulunan alt kriter için de bir önem sıralaması elde edilmiştir. Duyarlılık skorlarına ait ortalamalar bazı uzmanlar için 0 olması nedeniyle aritmetik ortalama yöntemine göre hesaplanmıştır. Buna göre alt kriterlerin duyarlılık oranlarının 0,18 ile 0,5 arasında değiştiği görülmektedir. Bunların da ortalama duyarlılık oranı ise 0,31 olarak bulunmuştur.

4.4.BWM Uygulaması

BWM yöntemi AHP’ye benzer olarak kriterlerin önem düzeyine göre sıralanması ve alternatifler içerisinde en iyi tercihi yapabilmek amacıyla kullanılmaktadır. Bu doğrultuda AHP’ye benzer uygulama BWM için de yapılmıştır. Buna göre ana kriterler düzeyinde elde edilen sonuçlar aşağıdaki gibidir.

Tablo 8. BWM Yöntemine Göre Ana Kriterler Düzeyinde Elde Edilen Sonuçlar

| Ana Kriterler | U1 | U2 | U3 | U4 | U5 | U6 | U7 | ORT | STD_ORT |
|----------------------|------|------|------|------|------|------|------|------|-------------|
| Faaliyet | 0,13 | 0,10 | 0,17 | 0,11 | 0,18 | 0,20 | 0,04 | 0,12 | 0,13 |
| Finansal Yapı | 0,05 | 0,26 | 0,17 | 0,14 | 0,14 | 0,20 | 0,18 | 0,15 | 0,16 |
| Karlılık | 0,13 | 0,12 | 0,17 | 0,17 | 0,14 | 0,20 | 0,24 | 0,16 | 0,17 |
| Likidite | 0,13 | 0,26 | 0,25 | 0,34 | 0,36 | 0,20 | 0,36 | 0,26 | 0,27 |
| Performans | 0,56 | 0,26 | 0,25 | 0,24 | 0,18 | 0,20 | 0,18 | 0,25 | 0,26 |
| Duyarlılık | 0,11 | 0,26 | 0,25 | 0,69 | 0,71 | 0,40 | 0,12 | 0,36 | |

Tablo 8’e göre ana kriterler önem düzeylerine göre sırasıyla; likidite, performans, kârlılık, finansal yapı ve faaliyet oranları olarak bulunmuştur. Her bir analiz için hesaplanan duyarlılık oranı ise 0,11 ile 0,71 arasındadır. Genel olarak duyarlılık oranlarına dikkat edildiği takdirde bazı kişiler tarafından doldurulan anketlerin daha tutarlı, bazılarının ise daha tutarsız olduğu görülmektedir. Bu durum kişiye göre değişmektedir. Ortalama duyarlılık skoru ise 0,36 olarak bulunmuştur. Alt kriterlere ait uygulama sonucu ise tablo 9’daki gibidir.

Tablo 9. AHP Yöntemine Göre Alt Kriterlerin İncelenmesi

| | Alt Kriterler | U1 | U2 | U3 | U4 | U5 | U6 | U7 | ORT | STD ORT |
|---------------|-------------------------|------|------|------|------|------|------|-------|-------------|--------------|
| Likidite | Cari Oran | 0,24 | 0,38 | 0,25 | 0,46 | 0,43 | 0,33 | 0,33 | 0,34 | 0,346 |
| | Asit Test Oranı | 0,59 | 0,38 | 0,38 | 0,31 | 0,32 | 0,33 | 0,33 | 0,37 | 0,378 |
| | Nakit Oran | 0,17 | 0,25 | 0,38 | 0,23 | 0,25 | 0,33 | 0,33 | 0,27 | 0,276 |
| | Duyarlılık | 1,18 | 1,50 | 0,38 | 0,92 | 1,27 | 0,66 | 0,33 | 0,78 | |
| Faaliyet | Alacak Devir Hızı | 0,14 | 0,19 | 0,18 | 0,15 | 0,19 | 0,18 | 0,19 | 0,17 | 0,179 |
| | Alacak Tahsilat Süresi | 0,14 | 0,13 | 0,18 | 0,11 | 0,19 | 0,18 | 0,13 | 0,15 | 0,152 |
| | Stok Devir Hızı | 0,14 | 0,19 | 0,18 | 0,06 | 0,19 | 0,18 | 0,19 | 0,15 | 0,157 |
| | Stok Devir Süresi | 0,14 | 0,19 | 0,18 | 0,07 | 0,19 | 0,18 | 0,125 | 0,14 | 0,151 |
| | Duran Varlık Devir Hızı | 0,09 | 0,13 | 0,12 | 0,22 | 0,11 | 0,12 | 0,19 | 0,13 | 0,139 |
| Finansal yapı | Aktif Devir Hızı | 0,35 | 0,19 | 0,18 | 0,37 | 0,14 | 0,18 | 0,19 | 0,21 | 0,223 |
| | Duyarlılık | 0,70 | 0,38 | 0,18 | 0,07 | 0,56 | 0,18 | 0,19 | 0,25 | |
| | Finansal Kaldıraç | 0,42 | 0,22 | 0,21 | 0,42 | 0,22 | 0,22 | 0,20 | 0,26 | 0,273 |
| | Genel Ödeme Gücü | 0,11 | 0,22 | 0,21 | 0,16 | 0,22 | 0,22 | 0,20 | 0,19 | 0,196 |
| | Özkaynak | 0,11 | 0,17 | 0,21 | 0,24 | 0,18 | 0,18 | 0,20 | 0,18 | 0,189 |
| Kârlılık | KVYK/Özkaynak | 0,04 | 0,17 | 0,14 | 0,07 | 0,15 | 0,15 | 0,20 | 0,12 | 0,123 |
| | Borçlanma Katsayısı | 0,32 | 0,22 | 0,21 | 0,12 | 0,22 | 0,22 | 0,20 | 0,21 | 0,219 |
| | Duyarlılık | 0,11 | 0,67 | 0,21 | 0,06 | 0,90 | 0,90 | 1,60 | 0,38 | |
| | Brüt Kar Marjı | 0,09 | 0,21 | 0,16 | 0,25 | 0,15 | 0,20 | 0,21 | 0,17 | 0,180 |
| | Net Kar Marjı | 0,17 | 0,21 | 0,23 | 0,39 | 0,23 | 0,20 | 0,21 | 0,23 | 0,236 |
| Performans | Özsermaye Karlılığı | 0,40 | 0,21 | 0,23 | 0,17 | 0,23 | 0,20 | 0,21 | 0,23 | 0,237 |
| | İktisadi Karlılık | 0,17 | 0,21 | 0,23 | 0,12 | 0,23 | 0,20 | 0,21 | 0,19 | 0,199 |
| | Aktif Karlılık | 0,17 | 0,14 | 0,15 | 0,07 | 0,15 | 0,20 | 0,16 | 0,14 | 0,148 |
| | Duyarlılık | 0,83 | 0,21 | 0,23 | 0,11 | 0,46 | 0,20 | 0,21 | 0,26 | |
| | Fiyat Kazanç | 0,42 | 0,23 | 0,20 | 0,42 | 0,20 | 0,20 | 0,20 | 0,25 | 0,262 |
| Performans | PD/DD | 0,16 | 0,23 | 0,20 | 0,24 | 0,20 | 0,20 | 0,20 | 0,20 | 0,210 |
| | Karpayı Dağıtım | 0,16 | 0,15 | 0,20 | 0,07 | 0,15 | 0,20 | 0,20 | 0,15 | 0,159 |
| | Karpayı Verim | 0,16 | 0,15 | 0,20 | 0,12 | 0,15 | 0,20 | 0,20 | 0,17 | 0,172 |
| | Hisse Başı Kar | 0,10 | 0,23 | 0,20 | 0,16 | 0,30 | 0,20 | 0,20 | 0,19 | 0,197 |
| | Duyarlılık | 0,41 | 0,46 | 0,20 | 0,06 | 0,60 | 0,20 | 0,20 | 0,25 | |

Tablo 9'a göre likidite oranlarından asit test oranı, faaliyet oranlarından aktif devir hızı, finansal yapı oranlarından finansal kaldıraç, kârlılık oranlarından net kâr marjı ve öz sermaye kârlılığının ve performans oranlarından fiyat kazanç oranının en önemli oldukları sonucuna ulaşılmıştır. Bununla birlikte her bir ana kriter altında bulunan alt kriter için de bir önem sıralaması elde edilmiştir. Alt kriterlerin duyarlılık oranlarının 0,25 ile 0,78 arasında değiştiği görülmektedir. Bunların da ortalama duyarlılık oranı ise 0,38 olarak bulunmuştur.

Bulguların Karşılaştırılması

AHP ve BWM yöntemleri ile elde edilen sıralamalar Spearman Korelasyon analizi ve elde edilen skorlar Mann Whitney U testi ile karşılaştırılmıştır. Buna göre korelasyon analizine göre ilişki katsayısı 0,578 çıkmış olup anlamlı bulunmuştur. Dolayısıyla her iki yönetime göre elde edilen sıralamalar arasında pozitif ve orta düzey bir ilişki olduğu tespit edilmiştir. Benzer şekilde her iki yöntem ile elde edilen öncelik skorları Bağımsız Örneklemeler-Mann Whitney U testi ile incelenmiştir. Bu aşamadaki hipotezler şu şekilde oluşturulmuştur;

H₀: AHP ve BWM yöntemleri sonuçları arasında anlamlı bir fark yoktur.

H₁: AHP ve BWM yöntemleri sonuçları arasında anlamlı bir fark vardır.

Hipotez testi analizi neticesinde testin anlamlılığı 0,702 olarak bulunmuştur. Bu durumda her iki yöntemeye dayalı üretilen önem düzeyleri arasında anlamlı bir fark olmadığını ifade eden H₀ hipotezi kabul edilmiştir. Yöntemlerin çıktılarının duyarlılık oranlarına dikkat edildiği takdirde, ana ve alt kriterler için AHP yöntemine göre verilen cevapların daha tutarlı olduğu gözlemlenmektedir. Bu farklılığın finansal oranların ayırımındaki zorluktan kaynaklandığı da söylenebilir. Örneğin, kârlılık oranlarından hangisinin en önemli olduğu, araştırma konusu olan sektöre göre farklı olabilmektedir. Dolayısıyla, finansal oranlarındaki yorum farklılıkları analizlerin çıktılarını doğrudan değiştirebilmektedir.

SONUÇ

Çalışmada literatürde sıklıkla performans ölçümlerinde kullanılan finansal oranların önem düzeylerinin ve ağırlıklarının AHP ve BWM yöntemleri ile karşılaştırmalı olarak belirlenmesi amaçlanmıştır. Çalışmanın veri seti, finans alanında akademik anlamda uzman olan yedi kişiye uygulanan anketler ile oluşturulmuştur. Yapılan uygulama neticesinde ana kriterler için performans ve likidite oranları her iki yöntemeye göre de önemli bulunmuştur. Faaliyet oranları ise her iki yöntemeye göre en az önemli kriter olarak dikkat çekmektedir.

Alt kriterler dikkate alındığı takdirde likidite oranları için sıralamanın her iki yöntem için farklı olduğu gözlemlenmektedir. Örneğin, nakit oran AHP'ye göre en önemli iken BWM'ye göre en az öneme sahip olarak değerlendirilmiştir. Bu durumun anketi dolduran kişilerin kriterleri değerlendirirken kararsız kalmalarından kaynaklandığı söylenebilir. Diğer alt kriterlerden faaliyet oranı için aktif devir hızı; finansal yapı için finansal kaldıraç; kârlılık için net kar marjı ve öz sermaye kârlılığı; performans oranları için fiyat kazanç ve PD/DD oranlarının her iki yöntemeye göre en önemli oldukları tespit edilmiştir.

Genel olarak her iki yöntem karşılaştırıldığı durumda; BWM, vektör tabanlı olması nedeniyle daha az veriye ihtiyaç duyulmaktadır. Örneğin, AHP için $n(n-1)/2$ adet veri gerekli iken BWM için $2n-3$ adet gereklidir. Tutarsızlık durumları açısından; verilen cevaplara göre eğer en iyi ve en kötü olarak tercih edilen değişkenlerin arasındaki önem farkı az ise AHP, BWM'ye göre daha iyi sonuçlar verebilmektedir. Anketin uygulanabilirliği açısından; BWM yönteminin daha kolay uygulanabilir olduğu gözlemlenmektedir.

Özetle; eğer değişkenler arasında en iyi/en kötü ayrımı net yapılamıyorsa, AHP yönteminin BWM'den daha iyi sonuçlar verdiği söylenebilir. İlerleyen zamanlarda yapılacak çalışmalarda, BWM ve AHP yöntemlerinin farklı konular kapsamında yeniden karşılaştırılması ve elde edilen sonuçların bu çalışmanın bulguları ile karşılaştırılması önerilebilir.

KAYNAKÇA

Abadi, F., Sahebi, I., Arab, A., Alavi, A., & Karachi, H. (2018). “Application of Best-Worst Method in Evaluation of Medical Tourism Development Strategy”. *Decision Science Letters*, 7(1): 77-86.

Aboutorab, H., Saberi, M., Asadabadi, M. R., Hussain, O., & Chang, E. (2018). “ZBWM: The Z-number Extension of Best Worst Method and its Application for Supplier Development”. *Expert Systems with Applications*, 107: 115-125

Akbulut R. & Rençber Ö. F. (2015) “BIST’te İmalat Sektöründeki İşletmelerin Finansal Performansları Üzerine Bir Araştırma” *Muhasebe ve Finansman Dergisi*, 65:117-136

Alimohammadlou, M., & Bonyani, A. (2017). “A Novel Hybrid MCDM Model For Financial Performance Evaluation In Iran’s Food Industry” *Accounting and Financial Control*, 1(2): 38-45.

Alkan, A., Kasımoğlu, H. Ç., Çelik, C., & Aladağ, Z. (2017). “AHP ve PROMETHEE Yöntemleri ile Lastik Üreticisi Bir Firma İçin Tedarikçi Seçimi”. *Sakarya University Journal of Science*, 21(2): 261-269.

Amoozad Mahdiraji, H., Arzaghi, S., Stauskis, G., & Zavadskas, E. K. (2018). “A Hybrid Fuzzy BWM-COPRAS Method for Analyzing Key Factors of Sustainable Architecture”. *Sustainability* 10(5): 1626

Aydın, Y., & Eren T. (2018). “Savunma Sanayiinde Stratejik Ürün İçin Çok Kriterli Karar Verme Yöntemleri İle Tedarikçi Seçimi”. *Ömer Halis Demir Üniversitesi Mühendislik Bilimleri Dergisi*, 7(1): 129-148.

Bakırcı F., Shiraz S. E. & Sattary A. (2014) “BIST’da Demir, Çelik Metal Ana Sanayii Sektöründe Faaliyet Gösteren İşletmelerin Finansal Performans Analizi: VZA Süper Etkinlik ve TOPSIS Uygulaması” *Ege Akademik Bakış Dergisi*, 14(1): 9-19

Bülbül S. E. & Köse A. (2016) “Türk Sigorta Sektörünün Promethee Yöntemi ile Finansal Performans Analizi” *Marmara Üniversitesi İİBF Dergisi*, 38(1): 187-210

BWM Bibliographical Database. Available from: https://www.researchgate.net/publication/317017936_BWM_Bibliographical_Database [Erişim:12.12. 2018].

Çalışkan, E., & Eren T. (2016). “Bankaların Performanslarının Çok Kriterli Karar Verme Yöntemiyle Değerlendirilmesi”. *Ordu Üniversitesi Bilim ve Teknoloji Dergisi*, 6(2): 85-107.

Demircanlı, B., & Kundakçı, N. (2015). “Futbolcu Transferinin AHP ve VIKOR Yöntemlerine Dayalı Bütünleşik Yaklaşım ile Değerlendirilmesi”, *Dokuz Eylül Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 30(2).

- Demireli E. (2010) "TOPSIS Çok Kriterli Karar Verme Sistemi: Türkiye'deki Kamu Bankaları Üzerine Örnek Bir Uygulama" *Girişimcilik ve Kalkınma Dergisi* 5(1): 101-112
- Ertuğrul, İ. & Karakaşoğlu, N. (2009). "Performance Evaluation of Turkish Cement Firms With Fuzzy Analytic Hierarchy Process And Topsis Method." *Expert Systems with Applications*(36): 702-715.
- Eshtaiwi M., Badi I.A., Abdulshamed A. & Erkan T. (2017) "Assessment of Airport Performance Using the Grey Theory Method: A Case Study in Libya" *Grey Systems, Theory and Application*, 7(3): 426-436
- Gergin, R. E., & Baki, B. (2015). "Türkiye'deki Bölgelerin Lojistik Performanslarının Bütünleştirilmiş AHS ve TOPSIS Yöntemiyle Değerlendirilmesi/Evaluation by Integrated AHP and TOPSIS Method of Logistics Performance in Turkey's Regions". *Business and Economics Research Journal*, 6(4): 115.
- Görener, A., & Sabuncuoğlu, O. (2016). "Bulanık TOPSIS Metodu ile Karar Verme: İnşaat Projelerinde Yüklenici Seçimi (Decision Making Through the Fuzzy TOPSIS Method: Contractor Selection in Construction Projects)". *International Journal of Research in Business and Social Science* (2147-4478), 5(2): 71-82.
- Gupta, H., & Barua, M. K. (2017). "Supplier Selection Among SMEs on the Basis of Their Green Innovation Ability Using BWM and Fuzzy TOPSIS". *Journal of Cleaner Production*, 152: 242-258
- Karaođlan, S., & Şahin, S. (2018). BİST XKMYA İşletmelerinin Finansal Performanslarının Çok Kriterli Karar Verme Yöntemleri İle Ölçümü ve Yöntemlerin Karşılaştırılması. *Ege Academic Review*, 18(1).
- Kazan H. (2010) "Karar Verme Teknikleri" Ders Notları, Kocaeli
- Liu, F., Zhao, S., Weng, M., & Liu, Y. (2017). Fire Risk Assessment for Large-Scale Commercial Buildings Based on Structure Entropy Weight Method. *Safety Science*, 94, 26-40.
- Mandic, K., Delibasic, B., Knezevic, S., & Benkovic, S. (2014). Analysis of the Financial Parameters of Serbian Banks Through the Application of the Fuzzy AHP and TOPSIS Methods. *Economic Modelling*, 43, 30-37.
- Ömürbek V. & Kınay B. (2013) "Havayolu Taşımacılığı Sektöründe TOPSIS Yöntemiyle Performans Değerlendirmesi" *SDÜ İİBF Dergisi*, 18(3) ss:343-363
- Raj, A., & Srivastava, S. K. (2018). Sustainability Performance Assessment of an Aircraft Manufacturing Firm. *Benchmarking: An International Journal*

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Rençber Ö. F. (2010) “Büyük Çaplı Projelerde Karar Verme: Analitik Hiyerarşi Süreci Uygulaması”
Yayımlanmamış Yüksek Lisans Tezi, GYTE Sosyal Bilimler Enstitüsü, Kocaeli

Rezaei, J. (2015). Best-Worst Multi-Criteria Decision-Making Method, *Omega*, 53, pp. 49-57.

Rezaei, J. (2016). Best-Worst Multi-Criteria Decision-Making Method: Some Properties and a Linear Model, *Omega*, 64, pp. 126-130.

Rezaei, J., Papakonstantinou, A., Tavasszy, L., Pesch, U., & Kana, A. (2018). Sustainable Product-Package Design in a Food Supply Chain: A Multi-Criteria Life Cycle Approach. *Packaging Technology and Science*

Şamiloğlu F. & Akgün A. (2015) “Finansal Tablolar Analizi” Ekin Yayınevi

Tayyar, N., Akcanlı, F., Genç, E., & Erem, I. (2014). BİST’e Kayıtlı Bilişim ve Teknoloji Alanında Faaliyet Gösteren İşletmelerin Finansal Performanslarının Analitik Hiyerarşi Prosesi (AHP) ve Gri İlişkisel Analiz (GİA) Yöntemiyle Değerlendirilmesi. *Muhasebe ve Finansman Dergisi*, (61), 19-40.

Vishnupriyan, J., & Manoharan, P. S. (2018). Multi-Criteria Decision Analysis for Renewable Energy Integration: A Southern India Focus. *Renewable Energy*, 121, 474-488

Yadollahi, S., Kazemi, A., & Ranjbarian, B. (2018). Identifying and Prioritizing the Factors of Service Experience in Banks: A Best-Worst Method. *Decision Science Letters*, 7(4): 455-464

Yayar, R. & Baykara, H. V. (2012). “TOPSIS Yöntemi İle Katılım Bankalarının Etkinlik ve Verimliliği Üzerine Bir Uygulama” *Business and Economics Research Journal*, 3 (4): 21-42.

Ek 1: Ana Kriterler İçin Uygulanan Örnek Anket Formu

AHP Yöntemi için Örnek Form

| | 1=Eşit | 3=Biraz daha fazla | 5=Fazla | 7=Çok fazla | 9=Aşırı derecede fazla | | | | | | | | | | | | | |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|---------------|
| GENEL FİNANSAL ORANLARIN KARŞILAŞTIRILMASI | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ... Oranları | 9 | 8 | 7 | 6 | 5 | 4 | 3 | 2 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | ... Oranları |
| Likidite | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Faaliyet |
| Likidite | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Finansal Yapı |
| Likidite | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Kârlılık |
| Likidite | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Performans |
| Faaliyet | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Finansal Yapı |
| Faaliyet | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Kârlılık |
| Faaliyet | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Performans |
| Finansal | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Kârlılık |
| Finansal | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Performans |
| Kârlılık | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | Performans |

BWM Yöntemi için Örnek Form

Aşağıdaki tabloda öncelikle en önemli ve en az önemli olan kriteri belirtiniz. Daha sonra her bir kriter ile en önemli kriter arasındaki tercih sırasını 1-9 arasında puan vererek belirtiniz. (1: En önemli)

| En Önemli Kriter | Likidite | Faaliyet | Finansal Yapı | Kârlılık | Performans |
|------------------|----------|----------|---------------|----------|------------|
| | | | | | |

Benzer şekilde öncelikle en az önemli gördüğünüz kriteri yazıp daha sonra diğer kriterler ile en az önemli olan kriteri karşılaştırınız. Bu aşamada da kriterlere 1 ile 9 arasında puan veriniz. (1: En az önemli)

| En Az Önemli Kriter | |
|---------------------|--|
| Likidite | |
| Faaliyet | |
| Finansal Yapı | |
| Kârlılık | |
| Performans | |

En önemli kriter için yapılan değerlendirmeye göre kriterler aşağıdaki gibi puanlanır;

| Önem Düzeyi | Tanım | Açıklama |
|-------------|---------------|---|
| 1 | Eşit Önemli | Karşılaştırılan iki kriter eşit öneme sahiptir |
| 3 | Kısmen Önemli | Karşılaştırılan kriter en önemliye göre kısmen önemli |
| 5 | Daha Önemli | Karşılaştırılan kriter en önemliye göre daha fazla öneme sahip |
| 7 | Çok Önemli | Karşılaştırılan kriter en önemliye göre çok daha güçlü önemli |
| 9 | En Önemli | Karşılaştırılan kriter diğer kriterler içerisinde en az öneme sahip |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

En az önemli kriter için yapılan değerlendirmeye göre kriterler aşağıdaki gibi puanlanır;

| Önem Düzeyi | Tanım | Açıklama |
|-------------|---------------|---|
| 1 | Eşit Önemli | Karşılaştırılan iki kriter eşit öneme sahiptir |
| 3 | Kısmen Önemli | Karşılaştırılan kriter en az önemliye göre kısmen önemli |
| 5 | Daha Önemli | Karşılaştırılan kriter en az önemliye göre daha fazla öneme sahip |
| 7 | Çok Önemli | Karşılaştırılan kriter en az önemliye göre çok daha güçlü önemli |
| 9 | En Önemli | Karşılaştırılan kriter diğer kriterler içerisinde en önemli |



**TÜKETİCİ GÜVEN ENDEKSİ İLE SEÇİLMİŞ FİNANSAL VE MAKROEKONOMİK
GÖSTERGELER ARASINDAKİ İLİŞKİ¹**

İbrahim Murat BİCİL*
Çağatay BAŞARIR**

Özer YILMAZ***

ÖZET

2008 yılında dünyada etkisi görülen finansal krizin bir sonucu olarak reel kesim ile tüketicilerin, ekonomik olaylar karşısındaki tepkilerinin ölçülmesi daha da önemli hale gelmiştir. Tüketiciler, bütçe kısıtının yanında gelecekteki ekonomik koşulların sağladığı güven ortamına bağlı olarak ta harcamalarını değiştirebilmektedirler. Bu nedenle birçok ekonomik değişken, tüketicilerin ekonomiye olan güvenlerinin azalmasına neden olabilmektedir. Çalışmada tüketicilerin güvenini etkileyebileceği düşünülen çeşitli makroekonomik ve finansal değişkenler ile tüketici güven endeksi arasındaki nedensellik ilişkisi ele alınmıştır. Nedensellik analizi bulguları tüketici güven endeksinden sanayi üretim endeksine doğru nedensellik ve BIST100 endeksi, dolar kuru ve tüketici fiyat endeksinden tüketici güven endeksine doğru nedensellik olduğunu göstermektedir.

Anahtar Kelimeler: Tüketici Güven Endeksi, Makroekonomik Değişkenler, Finansal Değişkenler, Granger Nedensellik Testi

Jel Kodları: C58, D12, E44

ABSTRACT

After the global crisis in 2008, the function of the confidence indices to measure the reaction of the real sector and consumers towards economic developments has started to gain importance. Consumers are increasing their spending not only due to budgetary constraints, but also due to the confidence environment provided by future economic conditions. Therefore, the decrease in consumer confidence due to many factors may lead to a decrease in consumer spending. In this study, the causality relationship between various macroeconomic and financial variables and consumer confidence index, which are thought to affect consumer confidence, are discussed. Analysis results show that there is a

¹ Bu Çalışma Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi BAP (Bilimsel Araştırma Projeleri Koordinasyon) Birimi tarafından desteklenmiştir. Proje No: BAP-18-ÖSUBF-1009-111

* Dr. Öğr. Üyesi, Balıkesir Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, Türkiye. muratbicil@balikesir.edu.tr

** Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi, Uygulamalı Bilimler Fakültesi, Ö.S. Uluslararası Ticaret ve Lojistik Bölümü, Türkiye, Türkiye, cbasarir@bandirma.edu.tr

*** Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi, Uygulamalı Bilimler Fakültesi, Ö.S. Uluslararası Ticaret ve Lojistik Bölümü, Türkiye, oyilmaz@bandirma.edu.tr

causality from the consumer confidence index to the industrial production index. The results also show that there is causality from BIST 100 index, the dollar rate and the consumer price index to the consumer confidence index.

Keywords: *Consumer Confidence Index, Macroeconomic Variables, Financial Variables, Granger Causality Test*

Jel Codes: *C58, D12, E44*

1.GİRİŞ

Makroekonomik ve finansal göstergelerin nasıl bir seyir izleyeceği iktisadi aktörlerin beklentilerinden önemli ölçüde etkilenmektedir. Beklentilerin izlenmesi finansal ve makroekonomik göstergelerin gelecekte izleyeceği seyir hakkında ön bilgiler sunmaktadır. Bu nedenle politika yapıcılar, finansal piyasa aktörleri ve reel sektör temsilcileri ekonomik göstergeleri izlemenin yanında öncü göstergeler olarak beklentileri yansıtan güven endekslerini de yakından izlemektedirler.

Keynes'e göre ekonomik gelişmelere karşı duyarlılık tüketicilerin uzun dönemdeki beklentilerinin ve güvenin durumu olarak ifade etmektedir. Ekonomide meydana gelen dalgalanmaların üretici ve tüketicilerin ekonomideki gelişmelere duyarlılığının yol açtığı düşünülmektedir. Bu kapsamda beklentilerin önemli bir rol üstlendiği söylenebilmektedir.

Tüketiciler tarafından yapılan tasarruf ve harcamalar sadece makroekonomik ve finansal değişkenlere göre değil aynı zamanda politik ve ekonomik istikrar gibi faktörlerden de etkilendiği belirtilmektedir. Tüketiciler tarafından yapılan harcamaların nedeni konusunda ekonomik veriler ile birlikte tüketicilerin etkileşim içerisinde oldukları sosyal çevrenin de etkili olduğu düşünülmektedir (Katona, 1975).

Tüketici güveninin makroekonomik değişkenlerle güçlü bir ilişkisi bulunmaktadır. “Ekonomik karar birimlerinin duygu, düşünce ve kararları psikolojik, sosyolojik ve politik kararlardan etkilendiği gibi birçok makroekonomik değişkenlerden de etkilenmektedir. Ekonomik durum göstergesinden biri olan güven endeksinin, ekonomik karar birimlerinin gelecek hakkındaki beklentilerini ve davranışları üzerinde etkisi bulunmaktadır” (Köse ve Akkaya, 2016).

Türkiye ekonomisinde beklentileri izlemede kullanışlı iki önemli güven endeksinden biri reel kesim güven endeksi diğeri ise tüketici güven endeksidir. Tüketici güven endeksi aylık Tüketici Eğilim Anketi sonuçlarından TÜİK tarafından hesaplanmaktadır. TÜİK tarafından uygulanan anket tüketicilerin mali durumlarının, genel ekonomiye ilişkin mevcut durum ve gelecekle ilgili beklentilerin, harcama ve tasarruf eğilimlerinin belirlenmesine ilişkin bilgiler sağlamaktadır. Anket sonuçlarından yararlanılarak hesaplanan tüketici güven endeksi beklentilere ilişkin öncü bir gösterge olup tüketicilerin

ekonomik aktivitelere ilişkin güvenindeki durumun olumlu olup olmadığını göstermektedir (TÜİK, <http://www.tuik.gov.tr/PdfGetir.do?id=27864>).

Tüketici güven endeksinin öncü bir gösterge olarak izlenmesi, bu endeksin makroekonomik ve finansal göstergeleri nasıl etkilediği ya da ilgili göstergelerden nasıl etkilendiği konusu merak uyandıran bir konudur. Bu çalışmada tüketici güven endeksinin etkilediği ya da ondan etkilendiği düşünülen seçilmiş makroekonomik ve finansal göstergelerle güven endeksi arasındaki nedensellik ilişkisi Granger nedensellik testi ile analiz edilmektedir.

Çalışma dört bölümden oluşmaktadır. Giriş bölümünde güven endeksinin ölçümü ve ekonomik göstergelerle ilişkisine değinildikten sonra ikinci bölümde Geçmiş yıllarda konuyla ilgili yapılmış olan çalışmalardan bazılarına yer verilmektedir. Çalışmanın üçüncü bölümü, araştırma ile ilgili veri ve yöntemin anlatıldığı ve araştırma bulgularının raporlandığı bölümdür. Son bölümde ise araştırma bulguları ile ilgili genel değerlendirme sunulmaktadır.

2.LİTERATÜR

Literatürde beklentilerin izlenmesinde önemli rolü olan farklı güven endekslerinin borsa endeksi, hisse senedi getirileri, döviz kuru, fiyat endeksleri, gayrisafi yurt içi hasıla, sanayi üretim endeksi gibi finansal ve makroekonomik göstergelerle arasındaki ilişkiler farklı dönemlerde çeşitli zaman serisi teknikleri ile analiz edilmiştir. Bunun yanı sıra literatürde güven endeksleri ile ekonomik dalgalanmalar arasındaki ilişkiyi konu edinen çalışmalara da rastlanmaktadır. Bu çalışmalardan bazıları aşağıda özetlenmiştir.

Afsar (2007) çalışmasında Amerika Birleşik Devletlerindeki tüketici, yatırımcı ve iş güvenirliliği endeksleri ile ekonomik dalgalanmalar arasındaki ilişkiyi VAR (Vektör ve Hata Düzeltme Modeli ile) araştırmışlardır. Çalışmada 1980-2005 yılları arasındaki çeyreklik veriler kullanılmıştır. Çalışmanın tüketici güven endeksi (CCI) ile ilgili sonuçları incelendiğinde öncelikle; tüketici güven endeksinin (CCI) GDP üzerinde anlamlı bir etkisinin olmadığı tespit edilmiştir. Araştırma da ayrıca uygulanan tahmini varyans ayrışması ile CCI'nın GDP'deki dalgalanmalar üzerinde kalitatif etkisinin olduğunu da bulmuştur.

Arabian ve Zomorrodian (2007) Amerika Birleşik Devletleri için 1980-2005 döneminde çeyreklik veriler kullanarak tüketici, yatırımcı ve işletme güven endeksleri ile ekonomik dalgalanmalar arasındaki ilişkileri VAR modeli ve vektör hata düzeltme modeli ile analiz etmişlerdir. Varyans ayrıştırmaları, tüketici güveninin, hisse senedi geri dönüşünün ve satın alma yöneticisi endeksinin GSYH'deki büyük farklılıkları açıkladığını göstermektedir. Genel olarak, sonuçlar güven endekslerinin ekonomik dalgalanmalarda önemli rol oynadığı görüşlerini teyit etmektedir.

Korkmaz ve Çevik (2009), Reel Kesim Güven Endeksi ile İMKB 100 endeks getirisi arasındaki ilişkiyi iki aşamalı dinamik nedensellik testini kullanarak analiz etmişlerdir. Öncelikle değişkenler

arasındaki ilişki EGARCH modeli ile tahmin edildikten sonra, modelden elde edilen standardize hata terimleri arasında ortalamada ve varyansta nedensellik ilişkisine bakmışlardır. Nedensellik ilişkileri sonucunda EGARCH modeli genişletilmiş ve sonuç olarak her iki değişkenin de birbirleri üzerinde pozitif etkisinin olduğu sonucuna varmışlardır. Son olarak EGARCH modeli ile genişletilmiş EGARCH modeli sonuçları karşılaştırılmış ve genişletilmiş EGARCH modelinin daha iyi sonuçlar verdiğini tespit etmişlerdir.

Bildirici ve Bozoklu (2010) MS-VAR yaklaşımı ile sanayi üretim endeksi, reel kesim üretim endeksi ve BIST 100 endeksi değişkenleri kullanılarak Türkiye’de beklentilerin ekonomi üzerindeki etkilerini analiz etmişlerdir. Çalışmada değişkenlere derinlik, diklik ve keskinlik asimetrisi uygulandıktan sonra MS-VAR modeli kullanılarak beklenti ve inancın ekonomi üzerindeki etkisi test edilmiştir. Elde edilen bulgular iktisadi karar birimlerinin beklentilerindeki iyimserlik ve kötümserlik dalgalanmaları ile ekonomide meydana gelen dalgalanmalar arasında ilişki olduğu yönündedir.

Topuz (2011), Türkiye için tüketici güveni ile hisse senedi fiyatları arasındaki ilişkiyi ölçtüğü 2004:01 ile 2009:01 dönemleri için analiz etmiştir. Çalışmada İMKB 100 endeksi ile tüketici güven endeksi arasındaki Granger nedensellik ilişkisi, değişkenlere ait aylık veriler kullanılarak test edilmiştir. Çalışmanın sonucunda, hisse senetlerinden tüketici güvenine doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi bulunmuştur.

Arısoy (2012), Türkiye’de tüketici ve reel kesim güven endekslerinin ekonomi üzerindeki etkisini ölçmek amacıyla, 2005: 01 ve 2012: 01 dönemleri arasındaki Sanayi Üretim Endeksi, tüketim harcamaları, Tüketici Güven Endeksi, İstihdam Oranı, Reel Kesim Güven Endeksi, İMKB Endeksi değişkenlerine ilişkin aylık verileri kullanarak iki farklı VAR modeli oluşturmuştur. Çalışmanın sonunda, Tüketici Güven Endeksinin tüketim harcamalarını; Reel Kesim Güven Endeksinin ise sanayi üretimindeki ve borsa endeksindeki gelişmeleri etkilediğini tespit etmiştir.

Dees ve Brinca (2013), ABD ve Euro Bölgesi için Tüketici Güven Endeksleri, Tüketim Harcamaları, Reel Harcanabilir Gelir, Finansal ve Gayrimenkul Serveti, Hisse Senedi Reel Fiyatları, Kısa Vadeli Faiz Oranları İşsizlik Oranları verilerini kullanarak 1985Q1 ile 2010Q2 dönemindeki çeyreklik verileri kullanarak değişkenler arasındaki ilişkiyi VAR ve Threshold Modelleri ile analiz etmişlerdir. Sonuç olarak, güven endeksinde meydana gelen değişikliklerin yüksek düzeyde olduğu zamanlarda güven endekslerinin harcamaları tahmin etme gücünü arttırdığı belirtilmektedir. ABD tüketici güven endeksi ile Euro bölgesi tüketici güven endeksi arasında bir ilişki olduğu, meydana gelen şokların geçişkenlik meydana getirerek güvenlik kanalı oluşturduğu yazarlar tarafından tespit edilmiştir.

Møller, Nørholm ve Rangvid (2014) çalışmalarında, Euro Bölgesine üye olan on bir ülkede, tüketici güveninin, çıktı açığı ve hisse senedi getirisi üzerindeki etkilerini araştırmışlardır. Çalışmada 1990-2010 yılları arasındaki aylık veriler kullanılmıştır. Kurulan regresyon denklemi ve bootstrap

simülasyonları analizleri sonucunda ülke bazlı elde edilen tüketici güveninin çıktı açıkları ve hisse senedi getirileri açısından anlamlı bir bilgi taşımadığı anlaşılmıştır. Çalışmada hisse senedi getirilerini açıklayabilmek için ülke bazlı tüketici güveni yerine Avrupa geneli tüketici güveninin kullanılmasının daha uygun olacağı ifade edilmiştir.

Kale & Akkaya (2016) çalışmalarında Türkiye'deki tüketici güveni ve reel sektör güven endeksi ile beş farklı hisse senedi endeksi (toplam, finansal, sanayi, hizmet ve teknoloji) arasındaki ilişki VAR modeli ile analize tabi tutulmuştur. Çalışmada 2004 yılı Ocak ile 2015 Haziran arasındaki aylık veriler kullanılmıştır. Yapılan analizler sonucunda, tüketici güven endeksi ile hisse senedi getirileri arasında anlamlı bir nedensellik ilişkisi tespit edilememiştir. Bununla birlikte hisse senetlerinin tüketici güven endeksi üzerinde pozitif yönlü ve anlamlı bir etkisinin olduğu bulunmuştur.

Usul, Küçüksille ve Karaoğlan, 2017 yılında yapmış oldukları çalışmalarında, güven endekslerindeki değişimlerin Borsa İstanbul'a olan etkisini ölçmeye çalışmışlardır. Çalışmada, 2007: 01 ve 2017: 01 dönemi aylık verilerini kullanmışlardır. Tüketici Güven endeksi ve Reel kesim güven endeksinin borsa İstanbul 100 üzerindeki kısa ve uzun dönem ilişkisini KSS eşbütünleşme analizini uygulayarak ölçmüşlerdir. Sonuç olarak, hem kısa hem de uzun dönemde Tüketici ve Reel Kesim Güven Endekslerinin BİST 100 Endeksini pozitif olarak etkilediklerini tespit etmişlerdir.

Eyüboğlu ve Eyüboğlu (2018) ARDL sınır testi yaklaşımı ile BIST sektör endeks getirileri ile reel kesim güven endeksi arasındaki ilişkiyi test etmişlerdir. Çalışmada değişkenler arasındaki kısa ve uzun dönemli ilişkiler ele alınmış ve reel kesim güven endeksi ile tüm sektör endeksleri arasında uzun ve kısa dönemde ilişki olduğu bulgusuna ulaşılmıştır. Bunun yanında kısa dönemde reel kesim güven endeksindeki artışın çoğunlukla borsa endeks getirilerini pozitif etkilediği görülmüştür. Nedensellik bulgularına göre sektör endekslerinden reel kesim güven endeksine doğru bir nedensellik ilişkisi olduğu gözlenmiştir.

3. VERİ, YÖNTEM VE BULGULAR

Çalışmada tüketici güven endeksi, sanayi üretim endeksi, BIST100 kapanış fiyatları, tüketici fiyat endeksi ve dolar kuru değişkenlerine ait 2012:1-2018:6 dönemine ilişkin aylık zaman serileri kullanılmıştır. Kullanılan verilere ilişkin zaman serileri TCMB elektronik veri dağıtım sitesinden alınmıştır. Granger nedensellik testi ve VAR modeli tahminine geçilmeden önce serilerin durağan olup olmadığını kontrol etmek ve durağan olmayan serileri durağanlaştırmak için birim kök testi uygulanmıştır. Birim kök testi sonucu durağan olmadığı tespit edilen ve farkları alınarak model tahmininde kullanılan serilerin sembollerinin başına birinci fark için "D" harfi, Birim kök testinin ardından değişkenler arasındaki nedensellik ilişkisi Granger nedensellik testi ile analiz edilmiştir.

3.1. Birim Kök Testi Sonuçları

Eğer bir stokastik süreç durağan değilse, serinin davranışı sadece ele alınan tahmin dönemi için geçerli olacaktır. Ancak seri hakkında diğer dönemler için bir genelleme yapılamayacaktır. Oysa bir zaman serisinde, şokların etkisinin geçici olması, bir süre sonra bu etkinin yok olması önemlidir. Zaman serilerinde amaç, geleceğe yönelik tahminlerde bulunmak ve tahmin dönemi dışında da değişkenlerin genel tavrı ya da eğilimini tespit etmeye çalışmaktır (Bozkurt, 2007). Bu nedenle, zaman serilerinde analizlere başlamadan önce serilerin durağanlıklarının tespit edilmesi gerekmektedir. Çalışmada değişkenlerin durağanlığını test etmek amacıyla Augmented Dickey Fuller ve Philips Perron birim kök testleri kullanılmıştır. Tüketici güven endeksi, sanayi üretim endeksi, BIST100 kapanış fiyatları, tüketici fiyat endeksi ve dolar kuru değişkenlerine ait zaman serilerine ilişkin ADF ve PP birim kök testleri sonuçları tablo-1'deki gibidir.

Tablo1. Birim Kök Testi Sonuçları

| PHILIPS PERRON BİRİM KÖK TESTİ SONUÇLARI | | | | | | |
|--|-------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | | DÜZEY | | | | |
| | | CCI | CPI | ER | BIST100 | IPI |
| Sabitli | t-Statistic | -3.1562 | 3.9162 | 1.8681 | -1.8167 | -3.5819 |
| | Prob. | 0.0266 | 1.0000 | 0.9998 | 0.3699 | 0.0083 |
| | | ** | | | | *** |
| Sabit ve Trend | t-Statistic | -3.6512 | 1.4253 | -1.4023 | -2.5022 | -9.6009 |
| | Prob. | 0.0320 | 1.0000 | 0.8527 | 0.3264 | 0.0000 |
| | | ** | | | | *** |
| | | BİRİNCİ FARK | | | | |
| | | d(CCI) | d(CPI) | d(ER) | d(BIST100) | d(IPI) |
| Sabitli | t-Statistic | -16.5880 | -5.4038 | -4.9340 | -7.6855 | -32.0931 |
| | Prob. | 0.0001 | 0.0000 | 0.0001 | 0.0000 | 0.0001 |
| | | *** | *** | *** | *** | *** |
| Sabit ve Trend | t-Statistic | -23.5996 | -6.4218 | -5.1396 | -7.6362 | -31.4591 |
| | Prob. | 0.0001 | 0.0000 | 0.0004 | 0.0000 | 0.0001 |
| | | *** | *** | *** | *** | *** |
| ADF BİRİM KÖK TESTİ SONUÇLARI | | | | | | |
| | | DÜZEY | | | | |
| | | CCI | CPI | ER | BIST100 | IPI |
| Sabitli | t-Statistic | -3.3499 | 3.9824 | 1.0834 | -1.7424 | 0.9027 |
| | Prob. | 0.0159 | 1.0000 | 0.9971 | 0.4062 | 0.9950 |
| | | ** | | | | |
| Sabit ve Trend | t-Statistic | -3.8018 | 2.3646 | -1.8717 | -2.2659 | -1.2175 |
| | Prob. | 0.0216 | 1.0000 | 0.6594 | 0.4469 | 0.8984 |
| | | ** | | | | |
| | | BİRİNCİ FARK | | | | |
| | | d(CCI) | d(CPI) | d(ER) | d(BIST100) | d(IPI) |
| Sabitli | t-Statistic | -7.4310 | -3.3612 | -5.1871 | -7.7448 | -7.3155 |
| | Prob. | 0.0000 | 0.0156 | 0.0000 | 0.0000 | 0.0000 |
| | | *** | ** | *** | *** | *** |
| Sabit ve Trend | t-Statistic | -7.4120 | -5.0379 | -5.4728 | -7.7004 | -7.3409 |
| | Prob. | 0.0000 | 0.0005 | 0.0001 | 0.0000 | 0.0000 |
| | | *** | *** | *** | *** | *** |

“Notes: (*)Significant at the 10%; (**)Significant at the 5%; (***) Significant at the 1%.”

Tablo-1'deki sonuçlara göre tüketici güven endeksine ilişkin serinin düzeyde, sanayi üretim endeksi, BIST100 kapanış fiyatları, tüketici fiyat endeksi ve dolar kuru değişkenlerine ilişkin serilerin birinci farklarında durağan oldukları tespit edilmiştir.

3.2 Granger Nedensellik Analizi

Granger 1969'a göre nedensellik aşağıdaki denklemlerde b_j 'nin sıfırdan farklı olması durumunda Y_t 'nin X_t 'ye neden olduğu, benzer şekilde c_j 'nin sıfırdan farklı olması durumunda X_t 'nin Y_t 'ye neden olduğu söylenir.

$$X_t = \sum_{j=1}^m a_j X_{t-j} + \sum_{j=1}^m b_j Y_{t-j} + \varepsilon_t \quad (1)$$

$$Y_t = \sum_{j=1}^m c_j X_{t-j} + \sum_{j=1}^m d_j Y_{t-j} + \eta_t \quad (2)$$

Granger nedensellik analizinde gecikme sayısı tespiti için olabilirlik (LogL), Akaike Bilgi Kriteri (AIC), Schwarz Bilgi Kriteri (SC), Hannan-Quinn bilgi kriterleri dikkate alınarak ve uygun gecikme uzunluğunda otokorelasyon sorunu olup olmadığı kontrol edilerek karar verilmiştir. Buna göre tüketici güven endeksi ile tüketici fiyat endeksi arasındaki nedensellik ilişkisi için en uygun gecikme uzunluğu 4 olarak belirlenirken, BİST 100, sanayi üretim endeksi ve dolar kuru ile nedensellik ilişkisi için uygun gecikme uzunluğu 1 olarak belirlenmiştir.

Tüketici güven endeksi ile sanayi üretim endeksi, BIST100 kapanış fiyatları, tüketici fiyat endeksi ve dolar kuru değişkenleri arasındaki nedensellik ilişkisi yukarıda belirtildiği biçimde ikiye ayrılarak test edilmiş ve bulgular tablo-2'de sunulmuştur.

Tablo 2. Granger Nedensellik Testi Sonuçları

| Null Hypothesis: | Obs | F-Statistic | Prob. |
|-------------------------------------|-----|-------------|--------|
| DIPI does not Granger Cause CCI | 77 | 1.36329 | 0.2467 |
| CCI does not Granger Cause DIPI | | 4.33435 | 0.0408 |
| DBIST100 does not Granger Cause CCI | 76 | 9.47739 | 0.0029 |
| CCI does not Granger Cause DBIST100 | | 1.44838 | 0.2327 |
| DER does not Granger Cause CCI | 76 | 8.75123 | 0.0042 |
| CCI does not Granger Cause DER | | 0.70086 | 0.4052 |
| DCPI does not Granger Cause CCI | 73 | 2.50282 | 0.0509 |
| CCI does not Granger Cause DCPI | | 1.75064 | 0.1499 |

Nedensellik analizi bulgularına göre tüketici güven endeksinden sanayi üretim endeksine doğru tek yönlü nedensellik, BIST100 endeksinden, dolar kurundan ve tüketici fiyat endeksinden tüketici güven endeksine doğru tek yönlü nedensellik ilişkisi vardır.

4.SONUÇ

Ekonomide beklentilerin makroekonomik ve finansal göstergeleri etkilediği ve bu göstergelerin izleyeceği seyirden de çeşitli kanallarla etkilendiği gözlemlenmektedir. Bu bağlamda tüketici güven endeksi beklentilerin izlenmesi bakımından önemli bir öncü gösterge olduğu bilinmektedir. Bu çalışmada TÜİK tarafından Tüketici Eğilim Anketi sonuçlarından yola çıkılarak hesaplanan tüketici güven endeksi ile sanayi üretim endeksi, BIST100 endeksi ve dolar kuru arasındaki nedensellik ilişkisi ele alınmıştır. Nedensellik analizi sonuçlarına göre tüketici güven endeksinden sanayi üretim endeksine doğru nedenselliğin varlığı ve BIST100 endeksi, dolar kuru ve tüketici fiyat endeksinden tüketici güven endeksine doğru nedenselliğin varlığına ilişkin kanıtlar elde edilmiştir.

KAYNAKÇA

- Afshar, T. (2007), "Stock Return, Consumer Confidence, Purchasing Manager's Index and Economic Fluctuations". *Journal of Business and Economics Research*, 5: 97-106
- Arabian, G., & Zomorrodian, R. (2007). "Stock Return, Consumer Confidence, Purchasing Manager's Index and Economic Fluctuations". *Journal of Business & Economics Research*, 5(8).
- Arısoy, İ. (2012). "Türkiye Ekonomisinde İktisadi Güven Endeksleri ve Seçilmiş Makro Değişkenler Arasındaki İlişkilerin VAR Analizi". *Maliye Dergisi*, 162: 304-315.
- Bildirici, M., & Bozoklu, Ü. (2010). "Beklentilerin Ekonomi Üzerine Etkileri: MS-VAR Yaklaşımı". TÜSİAD-Koç University Economic Research Forum Working Paper Series No:1019
- Bozkurt H., (2007). "Zaman Serileri Analizi", Ekin Basım Yayın, Bursa.
- Dees, S., & Brinca, P. S. (2013). "Consumer Confidence as a Predictor of Consumption Spending: Evidence for the United States and the Euro Area". *International Economics*, 134: 1-14. Doi: <https://doi.org/10.1016/j.inteco.2013.05.001>
- Eyüboğlu, S., & Eyüboğlu, K. (2018). "Reel Kesim Güven Endeksi ile Borsa İstanbul Sektör Endeksleri Arasındaki İlişkinin Test Edilmesi". *Business & Economics Research Journal*, 9(1): 75-86
- Köse, A., & Akkaya, M. (2016). "Beklenti ve Güven Anketlerinin Finansal Piyasalara Etkisi: BİST 100 Üzerine Bir Uygulama: An Application on BIST 100.
- Granger, C. W. (1969). "Investigating Causal Relations by Econometric Models and Cross-Spectral Methods. *Econometrica*" *Journal of the Econometric Society*, 424-438.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Kale, S., & Akkaya, M. (2016). "The Relation Between Confidence Climate and Stock Returns: The Case of Turkey". *Procedia Economics and Finance*, 38: 150-162.

Katona G.(1975) "Psychological Economics". New York: Elsevier Scientific Publishing Company.

Korkmaz, T., & Çevik, E. İ. (2009). "Reel Kesim Güven Endeksi ile İMKB 100 Endeksi Arasındaki Dinamik Nedensellik İlişkisi". *Istanbul University Journal of the School of Business Administration*, 38(1): 24-37

Møller, S. V., Nørholm, H., & Rangvid, J. (2014). "Consumer Confidence or the Business Cycle: What Matters More for European Expected Returns?". *Journal of Empirical Finance*, 28: 230-248.

TCMB- Türkiye Cumhuriyeti Merkez Bankası (2018), Elektronik Veri Dağıtım Sistemi, <https://evds2.tcmb.gov.tr/index.php?/evds/serieMarket>

Topuz, Y. V. (2011). "Tüketici Güveni ve Hisse Senedi Fiyatları Arasındaki Nedensellik İlişkisi: Türkiye Örneği". *AİBÜ-İİBF Ekonomik ve Sosyal Araştırmalar Dergisi*, 7 (1): 53-65.

TÜİK (2018) Tüketici Güven Endeksi, <http://www.tuik.gov.tr/PreHaberBultenleri.do?id=27864>

Usul, H., Küçüksille, E., & Karaoğlan, S. (2017). "Güven Endekslerindeki Değişimlerin Hisse Senedi Piyasalarına Etkileri: Borsa İstanbul Örneği". *Süleyman Demirel University Journal of Faculty of Economics & Administrative Sciences*, 22(3): 685-695.

ICOAEF
Extended With
Social Sciences

TEKNOLOJİ İŞLETMELERİNDE SIKI- GEVŞEK ÖRGÜT KÜLTÜRÜ VE KİŞİ-ÖRGÜT UYUMUNUN ÇİFT YÖNLÜLÜĞE ETKİSİ

Dr. Öğretim Üyesi Saadet Ela PELENK *

ÖZET

Sürekli değişen ekonomik, kültürel ve çevresel şartlar, işletmelerin de değişmesini gerektirmektedir. İşletmeler bir yandan ellerindeki kaynakları verimli olarak kullanmak, diğer yandan yeni teknoloji, ürün ve süreçlere uyum sağlayacak bir esneklikte olmalıdır. İşletmenin her iki stratejiyi bir arada kullanabilme yeteneği, çift yönlülük olarak tanımlanmıştır. Bu bağlamda işletmeye bu esnekliği sağlayacak bir örgüt kültürü de önemlidir. Kuralların anlaşılması yanında, otonominin de sağlanması gerekir. Diğer yandan çalışanların, kendi değerlerinin örgüt değerleri ile uyumluluğunu sağlayarak sürece katkıda bulunurlar. Araştırmanın amacı, örgüt kültürü, kişi- örgüt uyumu ve çift yönlülük ilişkisini tespit etmektir. Çalışma yenilikçiliğin yaygın olarak kullanıldığı teknoloji sektöründe öncü iki işletmenin 202 çalışanı ile anket yönteminden yararlanarak yapılmıştır. Araştırma sonucuna göre kişi-örgüt uyumu çift yönlülük üzerinde etkili olurken; sıkı-gevşek örgüt kültürü birlikte çift yönlülüğe etki etmemektedir.

Anahtar kelimeler: *Sıkı-Gevşek Kültür, Çift Yönlülük, Kişi- Örgüt Uyumu, Teknoloji*

Jel Sınıflandırması: *M10, M13, M14, M12*

THE EFFECT OF TIGHTNESS- LOOSE ORGANIZATIONAL CULTURE, PERSON- ORGANIZATION FIT ON AMBITEXTERITY IN TECHNOLOGY BUSINESSES

ABSTRACT

The ever-changing economic, cultural and environmental conditions require a change in the enterprises. Businesses should be able to use their resources efficiently and on the other hand to be flexible enough to adapt to new technologies, products and processes. The ability of the enterprise to use both strategies together is defined as ambitexterity. In this context, an organizational culture that will provide this flexibility to the business is also important. Besides understanding the rules, autonomy should also be provided. On the other hand, employees contribute to the process by ensuring that

* Recep Tayyip Erdoğan Üniversitesi, Fındıklı Uygulamalı Bilimler Yüksek Okulu, Bankacılık ve Finans Bölümü, 53700, Fındıklı, Rize, Türkiye, e-mail: saadetela.pelenk@erdogan.edu.tr, ID: 0000-0002-8068-5518

organizational values are compatible with their values. The aim of the study is to determine the effect of organizational culture and person-organization fit on ambisexterity. The study is carried out by using the survey method with 202 employees of two leading enterprises in the technology sector, where innovation is widely used. According to the results of the study, while the person-organization fit has an effect on ambisexterity; tight-loose organizational culture does not effect the ambisexterity.

Key words: *Tight-Loose Culture, Ambisexterity, Person-Organization Fit, Technology.*

Jel Classifications: *M10, M13, M14, M12*

1.GİRİŞ

İşletmenin temel felsefe ve politikaları üzerinde ortak bir dil oluşturan sıkı kültürde, diğer yandan az sayıda yönetici tarafından yönetilen bir işletmede, prosedürlerin kısıtlı olmasına işaret eden gevşek kültürde radikal ya da artımsal bir hareket seyri, çalışanların kültürü nasıl algıladığına bağlıdır. Çalışanların işletme misyonu dâhilinde hareket etmesi, kişi-örgüt uyumundan etkilenmektedir. Çift yönlülük olarak tanımlanan, işletmenin mevcut ve potansiyel kaynaklarının her ikisini de kullanması anlamına gelen kavram (Benner ve Tushman, 2003; Levinthal ve March, 1993), işletme kültüründen etkilenmektedir (Tushman ve O'Reilly, 1996) Birçok araştırmacı tarafından kişi-örgüt uyumu araştırılmak ile birlikte (Joyce & Slocum, 1984; Tom, 1971; Graham, 1976), kişi-örgüt uyumu, kültür ve çift yönlülük üzerine yapılan çalışmaların sayısı sınırlıdır. Araştırmanın amacı, “sıkı-gevşek örgüt kültürü, kişi-örgüt uyumu ve çift yönlülük” arasındaki ilişkiyi incelemektir. Çalışmanın, çift yönlülük, sıkı-gevşek örgüt kültürü ve kişi-örgüt uyumu ilişkisini teknoloji sektörü açısından değerlendirerek literatüre katkı vereceği umulmaktadır.

2.KAVRAMSAL ÇERÇEVE

2.1. Sıkı- Gevşek Örgüt Kültürü

Hofstede vd. (1998)'in ifadesi ile kültür, çalışanların birbirini anlamaları ve örgüt norm-değerlerini anlamlı bulmalarına göre sıkı ya da gevşek olarak ayrılmaktadır. Sıkı kültür, işletmenin temel değerlerinin paylaşılması ve kabulüdür. İşletme çalışanlarının sıkı biçimde örgütlenmesi, çalışanların işletme değerlerini anlaması ve birbirlerine saygı göstermesi olarak tanımlanabilir. Sıkı bir kültürün özellikleri şu şekilde sıralanabilir (Özkalp ve Kirel, 2004):

- Örgütün temel vazifesi ve politikaları konusunda ortak anlayışın gelişmesi,
- Örgüt üyelerini bir arada tutan ve iletişimi kolaylaştıran ortak dilin oluşması,
- Kimlik, aidiyet ve güven duygusunun gelişmesi,
- Yeni üyelerin intibakının kolaylaşması,
- Örgüt üyelerinin sorumluluk alma ve sahiplenme eğilimlerinin artması,

Örgüt içi dostluk bağlarının güçlenmesi,

Amaçlara dönük davranış kalıplarının edinilmesi,

Denetim ve motivasyonun kolaylaşması,

Örgütsel bağlarının artmasıdır.

Gevşek kültür, çalışanların az sayıda yönetici tarafından yönetilmesi, diğer yandan yönetmelik ve prosedürlerin azlığına işaret etmektedir. Gevşek kültürün özellikleri ise aşağıdaki gibidir:

Kendilerini başarıya götürecek açık ve seçik bir misyona sahip değildirlir.

Birçok değer ve inanç varlığı söz konusu olabilmekte; ancak hangilerinin daha önemli olduğu net değildir.

Farklı birimler, çatışan değerlere sahiptirler.

Yönetim, tüm kurumda geçerli bir anlayışı geliştirme çabası göstermemektedir.

İş görme yöntemleri geleneksel hâle gelmemiştir, herkes işi bildiği gibi yapmaktadır.

Çalışanları mutsuzdur, çatışma ve kavga sıklıkla görülmektedir (Özkalp ve Kirel, 2004).

2.2. Çift Yönlülük

Çift yönlülük kavramı ilk kez Duncan (1976) tarafından literatüre katılmıştır. Bu noktada kavram, işletmenin hem mevcut kaynaklarından yararlanması hem de potansiyel kaynaklarını değerlendirerek iki stratejiyi birlikte yönetmesidir. Bu noktada çift yönlülük işletmenin hem artımlı hem de radikal yenilikçiliği eşzamanlı takip etme yeteneği olarak tanımlanabilir (Tushman ve O'Reilly, 1996).

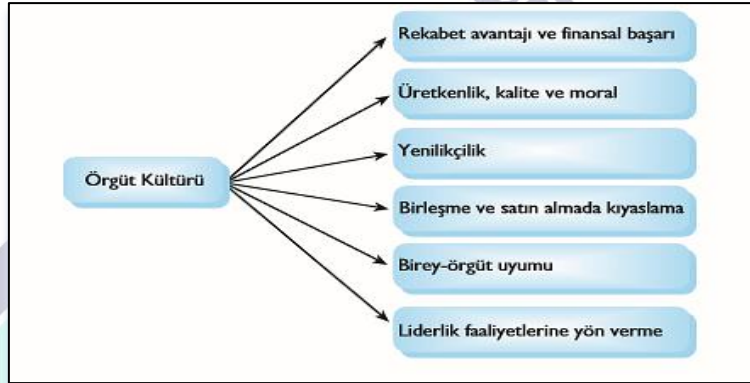
March (1991), çift yönlülüğü keşfedici ve yararlanıcı olarak iki boyutta incelemiştir. Keşfedici işletme boyutu ürün, hizmet ya da organizasyonel yeniliklerin üretilmesi için risk almak, çeşitlilik yapmak, dolayısıyla fikri ticarileştirmek isteğindedir (Benner ve Tushman, 2003; Levinthal ve March, 1993). Bu nedenle çalışanlara sorumluluk ve yetki verilir, ademi merkeziyetçi örgüt yapısı mevcuttur. Bu dönemde yeni bilgi ve tasarımlardan uzun dönemli fayda sağlanır. Diğer yandan yararlanıcı işletme boyutunda mevcut teknoloji ve sistemden olabildiğince yararlanılır ki rutin kurallar, standartlar ve merkeziyetçi örgüt yapısı bu boyutta yer alan özelliklerdir. Yararlanıcı boyutta, mevcut pazar portföyü ve dağıtım kanalları kullanıldığından kısa vadeli işletme çıktıları elde edilmektedir (Jansen, 2005).

2.3. Kişi-Örgüt Uyumu

Kişi-örgüt uyumu, bireyin değer ve inançlarına uyumlu işletmelerde pozisyon sahibi olması ile ilgilidir (Schneider, 1987). İlgili çalışması, kişi-örgüt uyumunda başlangıç kabul edilmekte olup, bu açıdan "bireyler rastgele durumlara göre göreve atanmazlar, aksine onlar için işletmede çekici olan durumları aramaktadırlar".

Kristof (1996), P-E uyumunun beş farklı seviyeye ayrıldığını savunmaktadır. Buna göre bir kişinin değerlerinin uygun olabileceği çalışma ortamının en yüksek seviyesi mesleki düzeydir ki kişi-meslek (P-V) uyumu olarak tanımlanmaktadır. İkinci seviye, bireyler ve kuruluşlar arasındaki uyumluluk olarak tanımlanan kişi-organizasyon (Person-Organization) uyumudur. Üçüncü seviye, bireyler ve çalışma grupları arasındaki uyumluluk olarak tanımlanan kişi-grup (P-G) uyumudur. Dördüncü seviye, bir kişinin yetenekleri ile bir işin talepleri arasındaki uyum olan kişi-işi (Person-Job) uyumudur. Son olarak, beşinci seviye, öncelikle dikey çift yönlü bağlanma ile ilgili literatürde tartışılan bir kişi ve onun yöneticisi arasındaki uyum ile ilgilidir. Bu tarz bir kişilik kişi-kişi (Person-Person) uyumu olarak nitelendirilmektedir. Tablo 1'e göre kişi- örgüt uyumu, örgüt kültürü sonuçları arasında yer almaktadır.

Tablo 1. Örgüt Kültürünün Sonuçları



Kaynak: Du Brin, A.J. (2005). Fundamentals of Organizational Behavior. Lousville, Canada, Thomson South- Western, s. 282'den aktaran Özkalp ve Kirel (2004).

Tablo 1'den de anlaşılacağı üzere kültür, iklim, değerler, amaçlar ve normlar gibi örgütsel özellikler ve kişisel özellikler ilişkilidir. Bu noktada işletmenin kişiye sağladığı fiziksel-psikolojik ve finansal kaynaklar da örgüt-kişi uyumunda önemlidir (Kristof, 1996).

2.4. Sıkı- Gevşek Örgüt Kültürü, Çift Yönlülük ve Kişi-Örgüt Uyumu İlişkisi

Peters ve Waterman (1982)'ye göre işletmelerin sahip olduğu gevşek kültür yapısı, çalışanların daha esnek ve baskı altında olmadan düşüncelerine yol açmaktadır. Çünkü otonomi ve karar yetkisi alt kademelere dağıtılmıştır. Bu durum çalışanların yaratıcılıklarını da arttırmaktadır. Örgütsel özelliklerin çeşitliliği, işletmelerin çift yönlülüğünü de arttırmaktadır. Çünkü hem sorumluluk bilinci hem de farklı görüşlerin fırsata çevrilebildiği bir ortam oluşmaktadır (Tushman ve O'Reilly, 1996; Wang ve Rafiq, 2009). Diğer yandan kişi-örgüt uyumunda görev ve işlerin sınıflandırılması gibi normatif özellikler de önemli görülmektedir (Rynes ve Gerhart, 1990). Atıcı vd. (2017), bireysel olarak yenilikçiliğe önem veren otel işletmelerinin yüksek düzeyde çift yönlülüğe sahip olduğunu tespit etmiştir. Schein (1992),

kişi-örgüt uyumunda, örgüt kültürü bileşenlerinin çalışanlar için rehber olduğunu belirtmektedir. O'Reilly vd. (1991), kişisel tercihler ve örgüt kültürü ilişkisini incelemiştir. Benner ve Tushman (2003); Voss vd.'e göre (2012) örgüt kültürünün rekabetçiliği, çift yönlülüğü arttırmaktadır.

3.METODOLOJİ

3.1. Araştırma Yöntemi ve Veri Toplama Aracı

Araştırmada 202 teknoloji çalışanı ile anket yapılmıştır. Araştırma modeli olarak, ilişkisel tarama yöntemi kullanılmıştır. Araştırmada veri toplama aracı olarak üç bölümden oluşan anket formu kullanılmıştır.

Anketin ilk bölümünde O'Reilly ve Tushman (2004) yılında geliştirilen "Sıkı- Gevşek Kültür Ölçeği" kullanılmıştır. Ölçekte 5'li Likert Tipi (1=Kesinlikle katılmıyorum, 2= Katılmıyorum, 3= Kararsızım 4= Katılıyorum, 5=Kesinlikle katılıyorum) kullanılmıştır. Ölçek 9 ifadeden oluşmaktadır. O'Reilly ve Tushman (2004); Fındıklı ve Pınar (2014) çalışmalarında sıkı örgüt kültürü faktörünün açıklanan toplam varyansı 38,364 olup, altı maddeden (1,2,3,5,7,9) oluşmaktadır. Faktör yükleri .819- .593 arasında değişmektedir. Aynı çalışmada gevşek örgüt kültürü faktörünün açıklanan toplam varyansı 25.84 olup üç maddeden (4,6,8) oluşmaktadır. Faktör yükleri .796- .653 arasında değişmektedir. Çalışmalarda yapılan güvenilirlik analizi sonucunda ölçeğin cronbach alfa katsayısı .804 olarak tespit edilmiştir. Alt faktörlerin güvenilirlik analizleri sonucunda, sıkı kültür boyutunun cronbach alfa katsayısı .844, gevşek kültür boyutunun cronbach alfa katsayısı .734 olarak belirlenmiştir.

Anketin ikinci kısmında Cao et al. (2009), Lubatkin vd. (2006) ve Keskin'in (2018) doktora tezinde kullanılan "Çift Yönlülük Ölçeği" kullanılmıştır. Ölçek 12 maddeden oluşmaktadır. Çalışmada ölçeğin cronbach alfa katsayısı .80, olarak belirlenmiştir. Ölçekte 5'li Likert Tipi (1=Kesinlikle katılmıyorum, 2= Katılmıyorum, 3= Kararsızım 4= Katılıyorum, 5=Kesinlikle katılıyorum) kullanılmıştır. Ölçek maddelerinden biri "İşletmem, yenilikçi ürün ve hizmetler üretmektedir" şeklindedir.

Anketin üçüncü kısmında Sarros vd. (2002) tarafından geliştirilen, Tuna'nın (2014) tezinde kullandığı ve 28 sorudan oluşan "Kişi-Örgüt Uyumu Ölçeği" kullanılmıştır. Ölçeğin cronbach alfa katsayısı .954 olarak ölçülmüştür. Ölçekte 5'li Likert Tipi (1=Kesinlikle katılmıyorum, 2= Katılmıyorum, 3= Kararsızım 4= Katılıyorum, 5=Kesinlikle katılıyorum) kullanılmıştır. Ölçek maddelerinden biri " Şu Anki İşim İyi Pozisyona İyi Ücret Verir" şeklindedir.

3.2. Veri Toplama Yöntemi

Uygulamada araştırmaya katılan çalışanlar ile anket yöntemi kullanılmıştır. Araştırma örneğinin seçimi ana kitleden kolayda örnekleme yöntemi ile yapılmıştır. Araştırmadan elde edilen anket formları değerlendirilmiş, 202 adet kullanılabilir anket formundan elde edilen veriler değerlendirmeye alınmıştır.

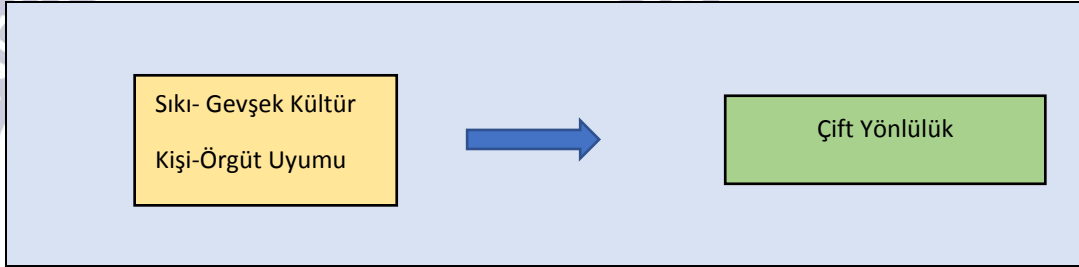
3.3. Araştırma Örneklemi

Araştırmaya katılan 202 teknoloji işletmesinde çalışanın 118'i erkek (%58,4); 84'ü kadındır (%41,6). Katılımcıların yaş ortalaması $32,42 \pm 7,37$ 'dir. Katılımcıların %82,2'si üniversite, %17,8'i lisansüstü düzeyde öğrenim görmüştür.

3.4. Araştırmanın Hipotezleri

Araştırmanın modeli aşağıdaki oluşturulmuştur (Şekil 1). Araştırma modelinde “sıkı-gevşek kültür ve kişi-örgüt uyumunun, çift yönlülüğe etkisi incelenmiştir. Modele göre “sıkı-gevşek kültür ve kişi-örgüt uyumu” bağımsız değişken; “çift yönlülük” bağımlı değişkendir.

Şekil 1. Araştırmanın Modeli



Araştırmanın modeli, Şekil 1'deki araştırmanın modeli çerçevesinde oluşturulmuştur. Buna göre, araştırmanın hipotezleri aşağıdaki gibidir:

H₁: Sıkı-Gevşek kültür, çift yönlülük üzerinde anlamlı ve pozitif olarak etkilidir.

H₂: Kişi-Örgüt uyumu, çift yönlülük üzerinde anlamlı ve pozitif olarak etkilidir.

3.5. Verilerin Analizi

Araştırma ile ilgili olarak elde edilen verilerin değerlendirilmesinde SPSS 21.0 istatistik yazılım programı kullanılmıştır. Araştırmanın değişkenlerinin ortalamaları, standart sapmaları ve normallik dağılımları belirlenmiştir. Araştırma hipotezlerinin doğrulanması amacıyla korelasyon ve regresyon analizleri yapılmıştır. Analizlerde anlamlılık düzeyi 0,01 olarak alınmıştır.

4. BULGULAR

4.1. Model Geçerliliği

Tablo 1'de modelin geçerli olup-olmadığına dair tablo Anova testi ile belirlenmiştir.

Tablo 1. Model Geçerliliği

| Model | Sum of Squares | df | Mean Square | F | Sig. |
|--------------|----------------|----|-------------|--------|-------------------|
| 1 Regression | 4,527 | 2 | 2,263 | 57,329 | ,000 ^b |
| Residual | 7,856 | 99 | ,039 | | |
| Total | 12,383 | 01 | | | |

a. Dependent Variable: Çift yönlülük, b. Predictors: (Constant: Sıkı-gevşek kültür, kişi-örgüt uyumu

Tablo 1'e göre araştırma modeli anlamlıdır (F: 57,329; R²= 0,36; 000^b). Tablo 2'de değişkenler arasındaki ilişkileri gösteren korelasyon tablosu yer almaktadır.

Tablo 2. Değişkenler Arasındaki Korelasyon Analizi Sonuçları

| | | çiftyön | uyum | kültür |
|---------|---------------------|---------|--------|--------|
| çiftyön | Pearson Correlation | 1 | ,604** | ,095 |
| | Sig. (2-tailed) | | ,000 | ,178 |
| | N | 202 | 202 | 202 |
| uyum | Pearson Correlation | ,604** | 1 | ,204** |
| | Sig. (2-tailed) | ,000 | | ,004 |
| | N | 202 | 202 | 202 |
| kültür | Pearson Correlation | ,095 | ,204** | 1 |
| | Sig. (2-tailed) | ,178 | ,004 | |
| | N | 202 | 202 | 202 |

** . Correlation is significant at the 0.01 level (2-tailed).

Tablo 2'ye göre kişi-örgüt uyumu ve örgütün çift yönlülüğü (, 604**) arasında anlamlı ilişki tespit edilmiştir. Aynı şekilde kişi-örgüt uyumu ile sıkı-gevşek örgüt kültürü (,204**) arasında anlamlı ilişki tespit edilmiştir. Ancak sıkı-gevşek örgüt kültürü ile çift yönlülük arasında anlamlı bir ilişki çıkmamıştır.

Tablo 3. Sıkı- Gevşek Kültür, Kişi-Örgüt Uyumu ve Çift Yönlülük değişkenlerine Yönelik Regresyon Analizi Sonuçları

| Model | | Unstandardized Coefficients | | Standardized Coefficients | t | Sig. |
|-------|------------|-----------------------------|------------|---------------------------|--------|------|
| | | B | Std. Error | Beta | | |
| 1 | (Constant) | 1,404 | ,316 | | 4,444 | ,000 |
| | uyum | ,700 | ,066 | ,610 | 10,574 | ,000 |
| | kültür | -,025 | ,050 | -,029 | -,504 | ,615 |

Tablo 3'e göre kişi- örgüt uyumu çift yönlülük üzerinde etkili iken; sıkı-gevşek kültür, çift yönlülük ilişkisi anlamlı çıkmamıştır. Araştırma sonuçlarına göre; kişi-örgüt uyumu çift yönlülükteki değişkenliğin %70'ini açıklamaktadır. Ancak sıkı-gevşek kültürün her ikisinin de bira arada yer alması, çift yönlülüğe etki etmemektedir. Dolayısıyla hipotezlere ait sonuçlar aşağıdaki gibidir:

H₁ Red = Sıkı-Gevşek kültür, çift yönlülük üzerinde anlamlı ve pozitif olarak etkilidir.

H₂ Kabul= Kişi-Örgüt uyumu, çift yönlülük üzerinde anlamlı ve pozitif olarak etkilidir.

5.SONUÇ

Gelişen teknoloji, işletmelerin rekabet güçlerinin artması işletmeleri çift yönlülük gibi bir ikileme sokmaktadır. Bu bağlamda işletme bir yandan mevcut fiziki ve beşeri kaynaklarını kullanarak varlığını devam ettirecek; diğer yandan farklı teknoloji ve alt yapıları kullanarak, yenilikleri takip ederek radikal atımlar yapacaktır. Bu noktada çalışanların esnek düşünebilen, krizi fırsata dönüştüren, kolektivist ve atılımcı yapıda olmaları gerekmektedir. Diğer yandan çalışanın değerlerine uygun bir işletme kültürü altında çalışması, daha verimli olmasını sağlamaktadır.

Teknoloji işletmeleri hizmet alanında yeniliği yakalayan ve çalışanlarının içselleştirmesini sağlayan bir alandır. Bu bağlamda geleceği şimdiden tasarlamak olan inovasyon, ancak mevcut kaynakların, potansiyel olanlar ile birlikte değerlendirilmesi ile gerçekleşebilir. Araştırma sonuçlarına göre; sıkı ve gevşek kültürün aynı anda çift yönlülüğe etkisi bulunmamıştır. Bu sonucun nedeni arasında kültürün tek boyut olarak düşünülmesi; bir bakıma henüz işletmelerde gevşek ve sıkı kültür ayrımının net olarak oturmamış olması da bulunabilir. Ancak yazında örgüt kültürü, çift yönlülüğü yapılandırmaktadır (Lee ve Yu, 2004; Jung vd., 2008). Diğer yandan, kişinin kendi tutum ve değerlerine uygun örgüt seçmesi yani kişi-örgüt uyumu, çift yönlülüğü anlamlı olarak etkilemektedir. Bundan sonraki çalışmalarda konu, farklı sektörlerde bağlılık, işten ayrılma gibi değişkenler açısından da incelenebilir.

KAYNAKÇA

- Atçı,D., Kale, A. ve Şeker, F. (2017) “Otel İşletmecilerinin Bireysel Yenilikçilik Profili ve Çift Yönlülük Düzeyi İlişkisi”, İşletme ve İktisat Çalışmaları Dergisi, 5 (3): 47-58.
- Benner, M.J. ve Tushman, M.L. (2003) “Exploitation, Exploration, and Process Management: The Productivity Dilemma Revisited”, Academy of Management Review, 28: 238-256.
- Cao, Q., Zhang, H. ve Gedajlovic, E.(2009) “Unpacking Organizational Ambidexterity: Dimensions, Contingencies, and Synergistic Effects”, Organization Science, 20(4): 781-796.
- Duncan, R. (1976). “The Ambidextrous Organization: Designing Dual Structures for Innovation. The Management of Organization”, New York: North Holland.
- Hofstede, G. ve Arrindell, W.A., Best, D.L., De Mooij, M. Hoppe, M.H., Van de Vliert, E., Van Rossum, J.H.A., Verweij, J., Vunderink, M. ve Williams, J.E. (1998) “Masculinity and Femininity: The Taboo Dimension of National Cultures”, Thousand Oaks CA: Sage.
- Fındıklı, M ve Pınar, İ. (2014). “Örgüt Kültürü Algısı ve Örgütsel Çift Yönlülük İlişkisi: Örgütsel Düzeyde Bilgi Paylaşımının Aracılık Etkisi”, Yönetim ve Ekonomi, 21(1).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Jansen, J. (2005) "Ambidextrous Organizations: a Multiple-Level Study of Absorptive Capacity, Exploratory and Exploitative Innovation and Performance", Rotterdam.
- Jung, D.D., Chow, C. ve Anne, W. (2008) "Towards Understanding the Direct and Indirect Effects of CEOs' Transformational Leadership on Firm Innovation", *The Leadership Quarterly*, 19(5): 582-594.
- Graham, W. (1976) "Commensurate Characterization of Persons, Groups and Organizations: Development of the Trait Ascription Questionnaire (TAQ)", *Human Relations*, 29: 607-622.
- Joyce, W. ve Slocum, J. (1984) "Collective Climate: Agreement as a Basis for Defining Aggregate Climates in Organizations", *Academy of Management Journal*, 27: 721-742.
- Keskin, F.F. (2018). "Relationship Between Social Capital, Information Sharing, Organizational Ambidexterity and Firm Performance In Technology Parks", A Thesis Submitted To The Graduate School of Social Sciences of Middle East Technical University, Ankara.
- Kristof, A.L.(1996) "Person-Organization Fit: An Integrative Review of its Conceptualizations, Measurement, and Implications", *Personnel Psychology*,49: 1-50.
- Lee, S., K.J. ve Yu, K. (2004) "Corporate Culture and Organizational Performance", *Journal of Managerial Psychology*,19 (4): 340-359.
- Levinthal, D. ve March, J.G. (1993) "The Myopia of Learning", *Strategic Management Journal*, 14: 95-112.
- O'Reilly, C.A., Chatman, J. ve Caldwell, D.F. (1991) "People and Organizational Culture: A Profile Comparison Approach To Assessing Person-Organization Fit", *Academy of Management Journal*, 34 (3): 487-516.
- Özkalp, E. ve Kirel, Ç. (2004) "Örgütsel Davranış". 2. Baskı, Eskişehir: Anadolu Üniv. Yayını.
- Peters, T. J. ve Waterman, R. H. (1982) "In Search of Excellence". New York: Harper and Row.
- Rynes, S. ve Gerhart, B. (1990) "Interviewer Assessments of Applicant "Fit": An Exploratory Investigation", *Personnel Psychology*, 43: 13-34.
- Sarros, J. C., Tanewski, G. A., Winter, R. P., Santora, J. C. ve Densten I. L. (2002) "Work Alienation and Organizational Leadership", *British Journal of Management*, 13: 285-304
- Schneider, B. (1987) "The People Make the Place", *Personnel Psychology*, 40: 437-453.
- Tom, V. (1971) "The Role of Personality and Organizational Images in the Recruiting Process", *Organizational Behavior and Human Performance*, 6: 573-592.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

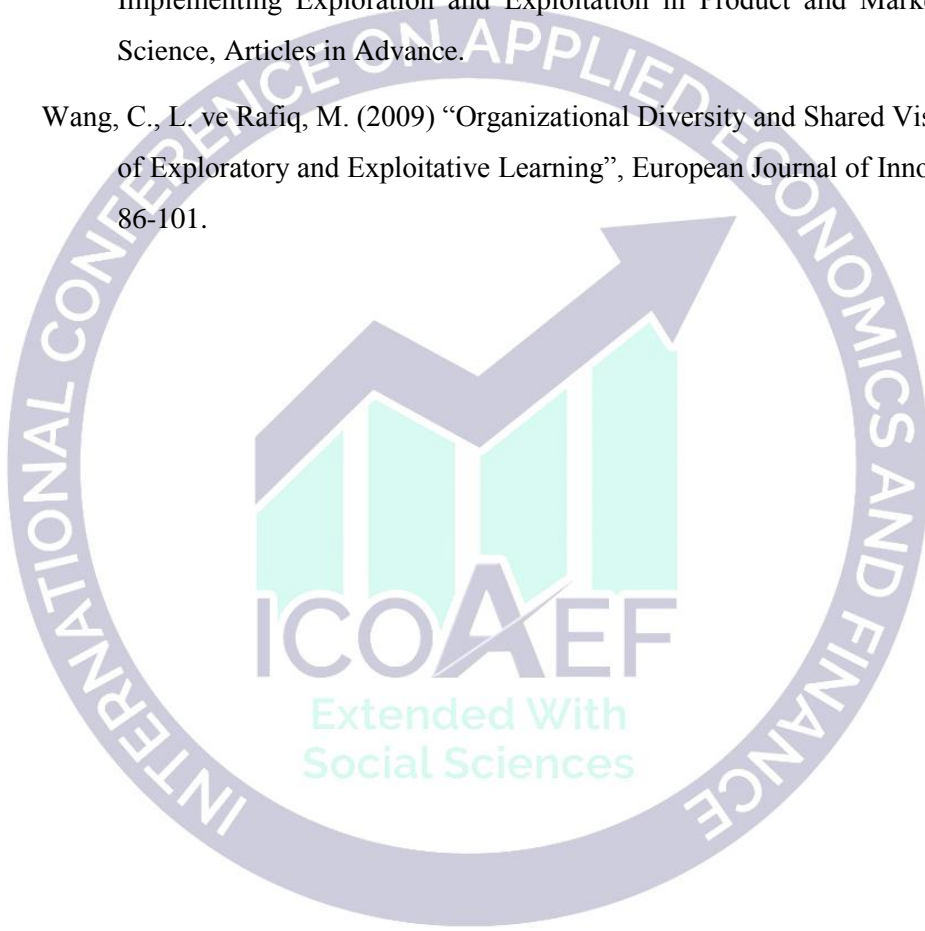
November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Tuna, B. (2014). "The Influence of Person-Organization Fit on Contextual Performance its Impact on Organizational Effectiveness: The Moderating Role of Organizational Climate", (Yayınlanmamış Doktora Tezi), Yeditepe University Graduate Institute of Social Sciences, İstanbul.

Tushman, M. ve O'reilly, C. (1996) "Ambidextrous Organizations: Managing Evolutionary and Revolutionary Change", California Management Review, 8-29.

Voss, G.B. ve Voss, Z.G. (2012) "Strategic Ambidexterity in Small and Medium Sized Enterprises: Implementing Exploration and Exploitation in Product and Market Domains", Organization Science, Articles in Advance.

Wang, C., L. ve Rafiq, M. (2009) "Organizational Diversity and Shared Vision: Resolving the Paradox of Exploratory and Exploitative Learning", European Journal of Innovation Management, 12(1): 86-101.



**İŞ YERİ MANEVİYATI, ÇALIŞMAYA TUTKUNLUK VE İŞ STRESİ ARASINDAKİ İLİŞKİ:
SAĞLIK SEKTÖRÜ ÇALIŞANLARI İLE BİR ARAŞTIRMA**

Dr. Öğretim Üyesi Saadet Ela PELENK *

ÖZET

Yoğun bir çalışma temposuna sahip hastaneler, çalışanların fiziksel ve psikolojik yapılarını olumlu-olumsuz etkilemektedir. Kaliteli hasta-personel ilişkisi ya da hizmet gibi unsurlar çalışanın işine fiziksel, duygusal ve bilişsel bağlanması ile mümkün olmaktadır. Bu noktada işini görevden ziyade, hayatın bir anlamı olarak gören çalışanın iş stresi de azalmaktadır. Araştırmanın amacı iş yeri maneviyatı, çalışmaya tutkunluk ve iş stresi arasındaki ilişkinin incelenmesidir. Buna yönelik İstanbul'da 2 özel hastanenin 151 sağlık personeli ile anket yapılmıştır. Araştırma sonuçlarına göre iş yeri maneviyatı ($\beta=-0,15$) ve işe tutkunluk ($\beta=-0,84$), iş stresini azaltmaktadır.

Anahtar kelimeler: İş yeri maneviyatı, Çalışmaya Tutkunluk, İş Stresi, Sağlık Sektörü, Örgütsel Stres

Jel Sınıflandırması: M10, M12, M19

**THE RELATIONSHIP AMONG THE WORKPLACE SPIRITUALITY, THE WORK
PASSION AND THE JOB STRESS: A RESEARCH WITH HEALTH SECTOR'S
EMPLOYEES**

ABSTRACT

Hospitals with an intense working tempo effect the physical and psychological structures of employees as positive or negative. Such as quality of patient-employees relationship or service, is possible with the physical, emotional and cognitive commitment of the employee's to work. At this point, the job stress of the employee, who perceives her/his job as a meaning of life rather than duty, is also decreasing. The aim of the study is to examine the relationship among work place spirituality, work passion and work stress. For this purpose, a questionnaire was conducted with 151 health personnel of 2 private hospitals in Istanbul. According to the results of the study, workplace spirituality ($\beta = -0,15$) and work passion ($\beta = -0,84$) reduce work stress.

Keywords: Work Spirituality, Work Passion, Job Stress, Health Sector, Organizational Stress

* Recep Tayyip Erdoğan Üniversitesi, Fındıklı Uygulamalı Bilimler Yüksek Okulu, Bankacılık ve Finans Bölümü, 53700, Fındıklı, Rize, Türkiye, e-mail: saadetela.pelenk@erdogan.edu.tr, ID: 0000-0002-8068-5518

1.GİRİŞ

İşletmenin ilerlemesi ve başarı kaydetmesi, güçlü ve dengeli bir performans gösteren çalışanlarına bağlıdır. İnsanoğlu için “anlam ve amaç” yakın kavramlar olup, anlamı bulmak aynı zamanda amaca da yaklaşımdır. İnsanın, anlamını bulduğu bir işi yapması ise var oluşunu zenginleştirir (Dökmen, 1999: 122). Bu bağlamda her insanın kendi doğasına ve varoluş özelliklerine göre değişen manevi bir altyapısı bulunmaktadır (Jawanmard, 2012: 1963).

İşyeri maneviyatı, kişinin vizyon sahibi olması, özverisi ve umutlu olmasına da etki edebilir. İş yaşamında maneviyat, bireyin amaç-değerlerinin işletme amaç ve değerleriyle uyumlu olması anlamına gelir (Ashmos ve Duchon, 2000; Gibbons, 1999; Mitroff ve Denton, 1999) ki böylesi bir ortamda çalışan, kendini tutkuyla işine verebilecektir.

İş stresi, çoğunlukla dışsal faktörlere bağlı olarak gelişen; bireyin, performansını ve yaşama sevincini düşüren negatif bir duygudur. İş stresinin belli bir noktaya kadar ulaşması (eşik noktası), kişiyi ters yönlü etkiyle hırslandırır da belli noktadan sonra stres artışı, kişiyi olumsuz etkilemektedir (Güçlü, 2001). Bu bağlamda fiziksel ve bilişsel sağlık sorunları baş göstermektedir. İş yaşamı da stres faktörlerini bulunduran bir ortamdır. Çalışanın, stresin negatif etkilerine karşı iç dengesini ve anlamı yakalaması, kendini işine vermesi işe tutkunluğunu arttıracaktır. Araştırmanın amacı, “işyeri maneviyatı, çalışmaya tutkunluk ve iş stresi” arasındaki ilişkinin incelenmesidir. Çalışma, stresin negatif ve yıkıcı etkilerine çözüm bulmak amacıyla işyeri maneviyatı ve çalışmaya tutkunluk kavramlarının önemine vurgu yapmakta olup, çalışmanın bu yönüyle literatüre katkı sağlayacağı umulmaktadır.

2.KAVRAMSAL ÇERÇEVE

2.1. İş yeri Maneviyatı

İşyeri maneviyatı, birçok araştırmacı tarafından farklı şekilde ifade edilmiştir. Genel olarak kavram, çalışanın bireysel ve iş değerleri arasındaki uyum ve bütünlük olarak nitelendirilebilir (Gibbons, 1999; Mitroff ve Denton, 1999). Bir bakıma kişinin, toplum tarafından da kabul edilen bir meslek ile beslenmesi ve ruhsal dinginliğe ulaşması; diğer yandan kendi değerlerini işine yansıtmasıdır (Ashmos ve Duchon, 2000).

Maneviyat, hakikati arayıştaki davranış, tutumlar ve değerlerdir (Sheep, 2006). İş yeri maneviyatı ise bireyin iş çevresi ile güçlü bağlantıları olması ve işine değer katmasını ifade etmektedir (Mitroff ve Denton, 1999). Bu noktada çalışanın, çevresindekiler ile içten bir iletişim kurması, saygı ve güven

çerçevesinde iş yeri için ortak bir vicdan oluşumunu da sağlamaktadır (Neal, 2000). Literatürde işyeri maneviyatının boyutları konusunda ortak bir tanım bulunmamakla birlikte, Milliman vd. (2003) “anlamli iş boyutu, topluluk bilinci boyutu ve kişi-örgüt değerleri uyumu” olarak üç boyutta incelemiştir. Ashmos ve Duchon (2000), maneviyatı “işsel yaşam, topluluk hissi ve anlamli iş” olarak sınıflandırmıştır. Sheep’e (2006), maneviyat sahibi çalışan iş yeri ile “düşünsel-fiziksel ve duygusal” bağlantı kurmakta, dolayısıyla iş yeri ile bütünleşmektedir. Diğer yandan işyeri maneviyatı ile çalışan, işini anlamli bulmakta ve kendini işine tamamen vermektedir. Bu bağlamda işine değer katarak, kendi sınırlarını aşmaktadır.

2.2. Çalışmaya Tutkunluk

İş yaşamına dair pozitif bir ruh hali ve iyi psikoloji olarak bilinen çalışmaya tutkunluk, bireyin duygusal ve bilişsel olarak kendini çalışmaya vermesi dolayısıyla iş rolünü, performansını arttıracak şekilde sürdürmesidir. Psikolojik olarak çalışanın işinde var olması olarak değerlendirilen işe tutkunluk, çalışanın işinde sergilediği yüksek enerji seviyesi ve güçlü kimlik olarak da adlandırılmaktadır (Schaufeli vd., 2002). Blanchard (2009)’a göre sekiz anahtar faktör işe tutkunluğu etkilemektedir:

1. Anlamli bir çalışma: Çalışanlar, üretilen ürün veya hizmetlerle kuruluşun daha büyük amacını algırlar, çalışmalarını değerli olarak görürler ve kuruluşun müşterisine hizmet etmesine yardımcı olan bireysel eylemleri ve katkıları ile gurur duyarlar.
2. İşbirliği: Çalışanlar, tüm organizasyon üyeleri arasında işbirliğini, işbirliğini ve cesaretlendirmeyi geliştiren bir organizasyonel ortam ve kültür algırlar.
3. Adil olma: Çalışanlar ücret, sosyal haklar, kaynak ve iş yükünün adil ve dengeli ve eşit olduğu, birbirlerini saygıyla davranan ve liderlerin etik bir şekilde hareket ettiği bir ortam algırlar.
4. Özerklik: Çalışanlar, insanların karar verme araçları, eğitimi, desteği ve yetkisi olduğu bir ortamı algırlar.
5. Tanıma: Çalışanlar, meslektaşları ve liderleri tarafından başarılarından ötürü övgü aldıkları, takdir ettikleri ve takdir ettikleri bir çevreyi algırlar, bu başarılar için maddi tazminat alırlar ve başkalarıyla pozitif ilişkilere katkıda buldukları yerler.
6. Büyüme: Çalışanlar, insanların öğrenme, mesleki gelişim ve ilerleme ve kariyer gelişimine yol açan becerilerini geliştirebilecekleri bir ortam algırlar.
7. Lider ile İletişim - Çalışanlar, liderlerine güvendikleri ve liderin kendileriyle kişilerarası bir ilişki kurma çabası içinde olduğu bir ortamı algırlar.
8. Çalışanlar ile İletişim - Çalışanlar, meslektaşlarına güvendikleri ve meslektaşlarının kendileriyle kişiler arası bir bağlantı kurma çabası içinde oldukları bir ortamı algırlar.

Çalışmaya tutkunluk, işletmenin genel politikası, prosedürleri, ürünleri ve yönetim uygulamalarından kaynaklanmakta olup; çalışanların adalet, adalet ve güven algılarını da içermektedir. Çalışmaya tutkunluğun sonuçları olarak iş tatmini ve örgüte bağlılık gibi pozitif tutumlar gösterilmektedir (Blanchard, 2009). Diğer yandan Vallerand vd. (2003), takıntılı ve uyumlu olarak iki tür tutkunluktan söz etmektedir. Bu iki sınıflandırma arasındaki ayrım, çalışmaya tutkunluk, kişinin kimliğinin bir parçası haline geldiğinde ortaya çıkan içselleştirme sürecinin sonucu olmaktadır.

2.3. İş Stresi

Stres, kişi üzerinde fiziksel ve psikolojik olarak baskı yapan, çevresel faktörlerden kaynaklı bir kavramdır (Artan, 1986). McGrath (1976), stresin çalışanın yeteneklerini ve var olan kaynakları değerlendirmesini engellediğini belirtmektedir. Bu bağlamda stres göreve, role, davranışsal ortama, çevreye ya da bireyin kendisine bağlı olarak ortaya çıkabilmektedir.

Cooper ve Marshall'a (1976) göre iş stresinin nedenleri arasında işin özellikleri, rol belirsizlikleri, çalışanlar arası iletişim sorunları, kariyer gelişim faktörleri, işletme yapısı (aşırı formalite, örgüt bölümlerinin birbirine bağlılığı vb.) gibi unsurlar sayılmaktadır. Bu noktada iş stresi, çalışanın iş çevresi işe uyumsuzluğunu arttırmakta, iyi-oluş halini tehlikeye sokmaktadır.

Caplan vd. (1975)'ne göre, iş stresi çalışanın olaylara normal tepkisini engellemektedir. İş stresi kaygı, ansikiyete bozukluğu, düşük benlik-özgüven gibi psikolojik; yüksek tansiyon, kötü kolesterol gibi fiziksel ve sigara içmek, iş ortamından sık ayrılma gibi davranışsal sonuçlara neden olmaktadır (Caplan vd., 1975).

2.4. İş Stresi, İş Yeri Maneviyatı ve Çalışmaya Tutkunluk Arasındaki İlişkiler

Lopez (2009) işyeri maneviyatının, çalışanın işe yönelik olumlu tutumunu ve verimliliğini arttırdığını tespit etmiştir.

Gockel (2004) maneviyatı, kişisel ve örgütsel krizleri daha kolay atlama yolu olarak değerlendirmektedir.

Kumar ve Kumar (2014), stres ve sağlık ilişkisinde maneviyatın moderatör etkisini incelediği çalışmada işyeri maneviyatının çalışanların sağlığında pozitif etkili, diğer yandan stresin, çalışanların sağlığında negatif etkili olduğunu tespit etmiştir.

Fry (2003), iş yeri maneviyatının tatmin, verimlilik, bağlılık ve sosyal sorumluluk değişkenlerini arttırarak, işkolizmden kaynaklı stresi azalttığını tespit etmiştir.

Crampton vd. (1995), güvenli iş ortamı, yönetici desteği, iş-görevlerin yeniden dizaynı gibi unsurlar iş stresini azaltmaktadır.

Bell vd. (2012), iş-yaşam dengesi ve iş stresi arasında doğru orantılı bir ilişki bulmuştur. Çalışanın işine verdiği önem ve değer aynı zamanda iç dengesine de bağlı olduğu vurgulanmıştır.

3.METODOLOJİ

3.1.Araştırmanın Yöntemi

Araştırmada 151 sağlık çalışanı ile anket yapılmıştır. Araştırma modeli olarak, ilişkisel tarama yöntemi kullanılmıştır. Bu metotta, mevcut durumu olduğu şekli ile betimlemek ve birden fazla değişkenin birbirlerine göre farklılaşıp farklılaşmadığı tespit etmek esastır.

3.2. Veri Toplama Aracı

Araştırmada veri toplama aracı olarak üç bölümden oluşan anket formu kullanılmıştır.

Anketin ilk bölümünde Ashmos ve Duchon (2000) tarafından geliştirilip, Milliman vd. (2003)'nin çalışmalarına uyarladıkları 21 ifadeden oluşan "İş Yeri Maneviyatı Ölçeği" yer almaktadır. Ölçek, "anlamli iş, topluluk bilinci ve iş yeri değerleri ile uyum" olarak üç alt boyuttan oluşmaktadır. Ölçekte elde edilen yüksek puan işyeri maneviyatının yüksek düzeyde olduğunu ifade etmektedir. Ölçek ifadelerinin ölçülmesinde, 5'li Likert Tipi derecelemeden yararlanılmıştır (1- Kesinlikle Katılmıyorum, 2-Katılmıyorum, 3-Kısmen Katılmıyorum 4-Katılıyorum 5- Kesinlikle Katılıyorum). Ölçeğin güvenilirlik ve geçerlilik çalışmaları yapılmıştır. Buna göre anlamli iş boyutunun güvenilirliği $\alpha=0.88$ olarak tespit edilmiştir. "Yaptığım iş hayatta önemli olduğunu düşündüğüm şeylerle bağlantılıdır", "İşim ruhuma olumlu enerji veriyor", "İşimi yaparken eğleniyorum" ve "Genellikle işe gelmek için sabırsızlanırım" ifadeleri bu ölçekte yer alan sorulardandır. Topluluk bilinci boyutuna ilişkin güvenilirlik $\alpha=0.91$ olarak tespit edilmiştir. "İş yerimdeki kişilerle işbirliği içinde çalışmayı değerli buluyorum", "İş yerimde kendimi bir topluluğun parçası gibi hissediyorum", "İş yerimde çalışanların ortak bir amaç ile birbirine bağlı olduğunu düşünüyorum" ve "İş yerimde insanların birbirlerini desteklediğine inanıyorum" ifadeleri bu boyuta ait sorulardır. İş yeri değerleri ile uyum boyutuna ilişkin güvenilirlik $\alpha=0.94$ olarak tespit etmiştir. "Kendimi iş yerimin hedeflerine bağlı hissediyorum", "İş yerimin bir bilinci/vicdanı vardır", "İş yerim ruhumun canlanıp, canlanmadığını önemser" ve "İş yerim tüm çalışanlarını önemser" ifadeleri bu boyuta ait soru tipleridir.

Anket formunun ikinci kısmında Schaufeli, Bakker and Salanova (2006)'nın geliştirdikleri 9 maddeden oluşan "İşe Tutkunluk" ölçeği kullanılmıştır. Schaufeli, Bakker ve Salanova (2006), işe tutkunluğun boyutlarının yerine tek bir değişken olarak ölçerken, kısaltılmış versiyonun (UWES-9) kullanılabileceğini belirtmiştir. Ölçek ifadelerini ölçülmesinde 5'li Likert Tipi derecelemeden yararlanılmıştır (1- Kesinlikle Katılmıyorum, 2-Katılmıyorum, 3-Kısmen Katılmıyorum 4-Katılıyorum 5- Kesinlikle Katılıyorum). Ölçeğin güvenilirlik ve geçerlilik çalışmaları yapılmıştır. KMO, örnekleme

yeterliliği değerinin .914 olarak tespit edilmiştir. Bartlett testi değerinin, verilerin faktör analizi için uygun (.000) olduğu görülmüştür. “Çalışmamda enerji ile yoğunluk hissediyorum”, “Çalışırken kendimi güçlü ve dinç hissediyorum” ve “İşim konusunda hevesliyim” ölçeğe dair ifadelerle örnek teşkil etmektedir. Ölçekte elde edilen yüksek puan işe tutkunluğun yüksek düzeyde olduğunu ifade etmektedir.

Anket formunun üçüncü kısmında Rizzo, House ve Lirtzman (1970) tarafından geliştirilen ve Yılmaz'ın (2010) doktora tezinde de kullandığı 17 maddeden oluşan “İş Stresi” ölçeğinden yararlanılmıştır. Ölçek ifadelerini ölçülmesinde 5’li Likert Tipi derecelemeden yararlanılmıştır (1- Kesinlikle Katılmıyorum, 2-Katılmıyorum, 3-Kısmen Katılmıyorum 4-Katılıyorum 5- Kesinlikle Katılıyorum). Ölçeğin güvenilirlik ve geçerlilik çalışmaları yapılmıştır. Ölçeğin KMO (.858) ve Bartlett (.000, df: 45) testleri yapılmıştır. “Görevimde ne kadar yetki sahibi olduğum konusunda bir fikrim vardır” ölçeğe ait soru türüne örnektir. Ölçekte elde edilen yüksek puan iş stresinin yüksek düzeyde olduğunu ifade etmektedir.

3.3. Veri Toplama Yöntemi

Uygulamada araştırmaya katılan çalışanlar ile yüz yüze anket yöntemi kullanılmıştır. Araştırma örneğinin seçimi ana kitleden kolayda örnekleme yöntemi ile yapılmıştır. Araştırmadan elde edilen anket formları değerlendirilmiş, 151 kullanılabilir anket formundan elde edilen veriler değerlendirmeye alınmıştır.

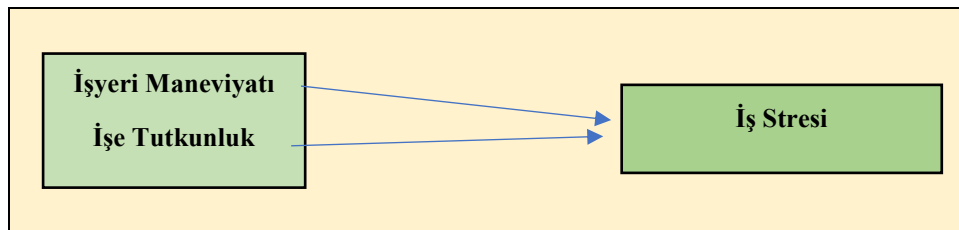
3.4. Araştırmanın Örneklemi

Araştırmaya katılan 151 iş görenin %43,2’si kadın, %56,7 ‘si erkektir. Katılımcıların yaş ortalaması $32,13 \pm 7,62$ olup; %44,7’si 30 yaş altı, %26,6’sı 31-35 yaş arası, %28,6’sı 36 yaş ve üstüdür. Katılımcıların %4,5’i doktora, %85,9’u üniversite, %9,5’i lisansüstü düzeyde öğrenim görmüştür.

3.5. Araştırmanın Modeli ve Hipotezleri

Araştırmanın modeli aşağıdaki oluşturulmuştur (Şekil 1). Araştırma modelinde “İş Yeri Maneviyatı Ve İşe Tutkunluk” bağımsız değişken, “İş Stresi” bağımlı değişkendir. Model, iş yeri maneviyatının ve işe tutkunluğun, iş stresi üzerindeki etkisini göstermektedir.

Şekil 1. Araştırmanın Modeli



Araştırmanın modeli, Şekil 1'deki araştırmanın modeli çerçevesinde oluşturulmuştur. Buna göre, araştırmanın hipotezleri;

H₁: İş yeri maneviyatı, iş stresini üzerinde etkili olup, iş stresini azaltmaktadır.

H₂: İşe tutkunluk, iş stresini üzerinde etkili olup, iş stresini azaltmaktadır.

3.6. Verilerin Analizi

Araştırma ile ilgili olarak elde edilen verilerin değerlendirilmesinde SPSS 21.0 istatistik yazılım programı kullanılmıştır. Araştırmanın değişkenlerinin ortalamaları, standart sapmaları ve normallik dağılımları belirlenmiştir. Araştırma hipotezlerinin doğrulanması amacıyla korelasyon ve regresyon analizleri yapılmıştır. Analizlerde anlamlılık düzeyi 0,01 olarak alınmıştır.

4. BULGULAR

4.1. Model Geçerliliği ve Betimsel Tablolar

İş stresi, işe tutkunluk ve iş yeri maneviyatı değişkenlerine ait verilerin ortalama etrafında dağılımına ait Tablo 1'deki gibidir.

Tablo 1. Betimsel Değişkenlerin İstatistikleri

| | Mean | Standart Sapma | N |
|-------------------|--------|----------------|-----|
| İş Stresi | 1,9322 | ,77361 | 151 |
| İş Tutkunluğu | 4,0883 | ,72751 | 151 |
| İşyeri Maneviyatı | 3,9742 | ,84998 | 151 |

Araştırmada 151 örneklem değerlendirilmiş olup; değişkenlerin ortalamadan sapmaları stres (1,9322±,77361), tutkunluk (4,0883±,72751) ve maneviyat için sırasıyla (3,9742±,84998) tespit edilmiştir.

Tablo 2. Modelin Açıklama Gücü

| Model | R | R ² | Düzeltilmiş R ² | Std. Error of the Estimate |
|-------|-------------------|----------------|----------------------------|----------------------------|
| 1 | ,942 ^a | ,887 | ,885 | ,26195 |

Tablo 2'ye göre işyeri maneviyatı ve çalışmaya tutkunluk değişkenlerinin, iş stresini açıklama gücü oldukça yüksek çıkmıştır (R²=%88). Modelin geçerliliğine dair Anova testi sonuçları Tablo 3'de gösterilmiştir.

Tablo 3. Anova Testi Sonuçları

| Model | Sum of Squares | df | Mean Square | F | Sig. |
|--------------|----------------|-----|-------------|---------|-------------------|
| 1 Regression | 79,614 | 2 | 39,807 | 580,114 | ,000 ^b |
| Residual | 10,156 | 148 | ,069 | | |
| Total | 89,770 | 150 | | | |

a. Bağımlı Değişken: İş Stresi

b. Öncüller (Sabit): Çalışmaya Tutkunluk ve İşyeri Maneviyatı

Tablo 3'e göre model anlamlı olup $F(2;150) = 580,114$, $p < 0,01$ $R^2 = 0,88$; model değişkenler arasındaki ilişkinin %39'unu açıklamaktadır.

4.2. Korelasyon ve Regresyon Tabloları

Tablo 4'de değişkenler arası ilişkileri yansıtan korelasyon tablosu gösterilmiştir.

Tablo 4. Değişkenler Arasındaki Korelasyon Analizi Sonuçları

| | | İş Stresi | İşe Tutkunluk | İşyeri Maneviyatı |
|-------------------|---------------------|-----------|---------------|-------------------|
| İş Stresi | Pearson Correlation | 1 | -,937** | -,821** |
| | Sig. (2-tailed) | | ,000 | ,000 |
| | N | 151 | 151 | 151 |
| İşe Tutkunluk | Pearson Correlation | ,937** | 1 | ,816** |
| | Sig. (2-tailed) | ,000 | | ,000 |
| | N | 151 | 151 | 151 |
| İşyeri Maneviyatı | Pearson Correlation | -,821** | ,816** | 1 |
| | Sig. (2-tailed) | ,000 | ,000 | |
| | N | 151 | 151 | 151 |

**p<0,01

Tablo 4'deki korelasyon analizi sonuçlarına göre işe tutkunluk (-,937**; ,000) ile iş stresi arasında ve işyeri maneviyatı (-,821**; ,000) ile iş stresi arasında ters yönlü ve anlamlı ilişki mevcuttur. Tablo 5'de bağımsız değişkenlerin (işyeri maneviyatının ve işe tutkunluğun), bağımlı değişkene (iş stresine) etkisi gösterilmiştir.

Tablo 5. İşyeri Maneviyatı, İşe Tutkunluk ve İş Stresine İlişkin Regresyon Analizi Sonuçları

| Model | Unstandardized Coefficients | | Standardized Coefficients | t | Sig. |
|-------------------|-----------------------------|------------|---------------------------|---------|------|
| | B | Std. Error | Beta | | |
| (Constant) | 6,016 | ,122 | | 49,264 | ,000 |
| İşyeri Maneviyatı | -,154 | ,044 | -,170 | -3,547 | ,001 |
| Tutkunluk | -,849 | ,051 | -,798 | -16,700 | ,000 |

a. Bağımlı Değişken: Stres

Tablo 5'e göre iş yeri maneviyatı ve iş stresi; çalışmaya tutkunluk ve iş stresi arasında anlamlı ilişkiler mevcuttur. Buna göre işyeri maneviyatındaki artış, iş stresi %17 civarında azaltmaktadır. Aynı şekilde işe tutkunluktaki artış, iş stresini %79 civarında azaltmaktadır.

Regresyon katsayıları (β) ve anlamlılığına (t) ilişkin sonuçlarına göre iş yeri maneviyatı ($\beta = -0,15$; $t = -3,54$; $p < 0,01$) ve işe tutkunluk ($\beta = -0,84$; $t = -16,7$; $p < 0,01$) değişkenlerinin her ikisi de iş stresi üzerinde anlamlı ve negatif etkiye sahip olduğu tespit edilmiştir. Elde edilen sonuçlara göre işyeri maneviyatı ve çalışmaya tutkunluğun, iş stresi üzerinde anlamlı ve önemli etkisi bulunmaktadır.

H₁ Kabul: İş yeri maneviyatı, iş stresini üzerinde etkili olup, iş stresini azaltmaktadır.

H₂ Kabul: İşe tutkunluk, iş stresini üzerinde etkili olup, iş stresini azaltmaktadır.

5.SONUÇ

Günümüzde çalışanlar, zamanlarının büyük çoğunluğunu işte geçirmektedir. Dolayısıyla iş ve iş çevresinin oluşturduğu unsurları pozitif ya da negatif algılamak, kişinin işteki başarısını da beraberinde getirmektedir. Literatürde ilk zamanlarda maneviyat ve iş ortamı bağdaştırılamasa da (Jurkiewics ve Giacalone, 2004); aslında kişinin işiyle bütünleşmesi, aradaki değer farklılığının en aza indirgenmesi ile mümkündür (Ashmos ve Duchon, 2000; Gibbons, 1999). Bu bağlamda iş yeri maneviyatı çalışanlara bir yön duygusu vermekte (Gibbons, 1999) ve temel amacını bularak iş çevresiyle güçlü bir bağ kurmasını sağlamaktadır (Milliman vd., 2003). İş yeri maneviyatı geliştiren kişiler ise işlerini daha anlamlı ve çekici bularak, verimli olmaktadır (Jawanmard, 2012).

Araştırma sonuçlarına göre, iş yeri maneviyatı ve çalışmaya tutkunluk iş stresini anlamlı olarak etkilemekte ve stresi azaltmaktadır. Çalışma zaman ve maliyet kısıtlarına sahip olduğundan, gelecekteki çalışmalarda stresin yoğun olarak yaşandığı diğer mesleklerde, bireylerin kişilik özellikleri de dikkate alınarak inceleme yapılabilir.

KAYNAKÇA

- Artan, I. (1986) “Örgütsel Stres Kaynakları ve Yöneticiler Üzerinde Bir Uygulama”, İstanbul: Özgün Matbaacılık.
- Ashmos, D. P. ve Duchon, D. (2000) “Spirituality at Work: A Conceptualization and Measure”, *Journal of Management Inquiry*, 9 (2): 134-145.
- Blanchard, C.B. (1999) “Passion Et Santé Physique. Unpublished Doctoral Thesis”, Université Du Québec À Montréal, Montréal, Québec, Canada.
- Caplan, R. D., Cobb, S., French, J. R. P., Jr., Van Harrison, R., and Pinneau, S. R. (1975) “Job Demands ve Worker Health: Main Effects and Occupational Differences”. Washington, D.C.: U.S. Government Printing Office.
- Cooper, C. L. ve Marshall, J. (1976) “Occupational Sources of Stress: A Review of The Literature Relating to CHD and Mental Ill-Health” , *Journal of Occupational Psychology*, 49: 11-28.
- Gibbons, P. (1999) “Spirituality at Work: Definitions, Measures, Assumptions and Validity Claims”, *Proceedings of the Academy of Management, USA*.
- Güçlü, N.(2001) “ Stres Yönetimi”, *Gazi Eğitim Fakültesi Dergisi*, 21(1): 91-109.
- McGrath, J. E. (1976). “Stress ve Behavior in Organizations”. In M. Dunnette (Ed.), *Handbook of Industrial and Organizational Psychology*. Chicago: Rand McNally.
- Milliman, J., Czaplewski, A. J. ve Ferguson, J. (2003). “Workplace Spirituality and Employee Work Attitudes: An Exploratory Empirical Assessment”, *Journal of Organizational Change Management*, (4): 426-447.
- Mitroff, I. A. ve E. A. Denton (1999) “A Study of Spirituality in the Workplace”, *Sloan Management Review*, 83–92.
- Neal, J. (2000) “Work As Service to Divine: Giving Our Gifts Selflessly and With Joy”, *American Behavioral Scientist*, 43 (8): 1316-1333.
- Schaufeli, W. B., Salanova, M., González-Romá, V. ve Bakker, A. B. (2002) “The Measurement of Engagement and Burnout: A Two Sample Confirmatory Factor Analytic Approach”, *Journal of Happiness Studies*, 3: 71–92.
- Vallerand, R.J., Rousseau, F.L, Grouzet, F.M.E., Dumais, A., Grenier, S. ve Blanchard, C.M. (2006) “Passion in Sport: A Look at Determinants and Affective Experiences”, *Journal of Sport and Exercise Psychology*, 28: 454–478.

**THE EFFECT OF PERSONALITY AND SELF-EFFICACY ON EMPLOYEE'S
PERFORMANCE IN NIGERIA HIGHER EDUCATION**

Abimbola OLADOTUN*

ABSTRACT

This research aims to find out the effect of personality and self-efficacy on employee performance in Nigeria higher education. The study adopted a quantitative research approach, with stratified sampling techniques. The study focused on Lagos State Polytechnic Staff, (academics and administrative staff). Data was collected through the use of three self-administered questionnaire in a survey with total of 63 questionnaire items and five Likert scale with sample of 200 staffs. Descriptive statistic, correlation, multiple regression and ANOVA was employed in order to analysis the data through SPSS version 21. The results shows that there is a significant and a positive relationship between personality, self-efficacy and employee performance and that self-efficacy has a higher correlation with task dimension of performance than contextual performance and also that self-efficacy has a more predictive power on performance than personality. In conclusion, employees who believe in their abilities perform better on their job. Recommendation is that staff should be trained to increase their belief in their abilities which will also increase their performance.

Key Words: *Big Five personality, Self-Efficacy, Employee Performance, Higher Education*

1. INTRODUCTION

There are many factors that contribute to individual performance level, some are external or extrinsic which others are internal or intrinsic, and among the internal factors are the individual personal characteristics, the employee dispositions, and opinion or idea of self-influence, what an employee is and what he/she does affect his work attitude and relationship at work. This research aims to know the relationship between personality and performance and how it contributes to it, which will solve some of the problems of recruitment, in order not to employ the wrong person for the job. It will bridge the gap of the right person for the job, in motivation studies, Intrinsic factors are said to highly motivate an employee than an extrinsic factor, but the absence of extrinsic with the presence of intrinsic increases the work performance but the presence of extrinsic and the absence of intrinsic does not increase work performance necessarily.

* Msc, Lagos State Polytechnic, Lagos, Nigeria, harbimborlar246@gmail.com, +2349038807587

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

There is a relationship between personality big five model dimension: Extraversion, Conscientiousness, Emotional Stability, Openness to Experience, Agreeableness and Employee's Performance. Person-job fit is adaptable to all form of job, levels in the organization and organization outcomes (Barrick, Mount, & Judge, 1991, 2001). Barrick et al, 2001 research results mentions that conscientiousness and not always emotional stability is highly correlated to job performance in any form of job, also that extraversion, openness and agreeable relationship to performance is contextual based on contingency factor, depending on the type of job, for example Extroversion only predict performance only in physical connective or inter communication job, while openness and agreeable predict better in coaching job, employee with an average level of agreeableness will find it easier to conform to the organization rules and regulations and standard of result unlike one who is low in agreeableness, an employee with a high level of conscientiousness are result oriented, who are likely to be a high performer, employee who are open to change can relate positively with the external environment of the organization, they can easily adapt to any adjustment just to reinforce their outputs.

This research aims to reduce employee's job deviant behavior, and also to increase the current state of employee's performance to a desired level, reducing the constrains and challenges in recruiting right people for the job, and to reduce likely high turnover rates in educational system,

Research Question:

The research questions stated below are the focus of this study;

Is there any relationship between personality and job performance

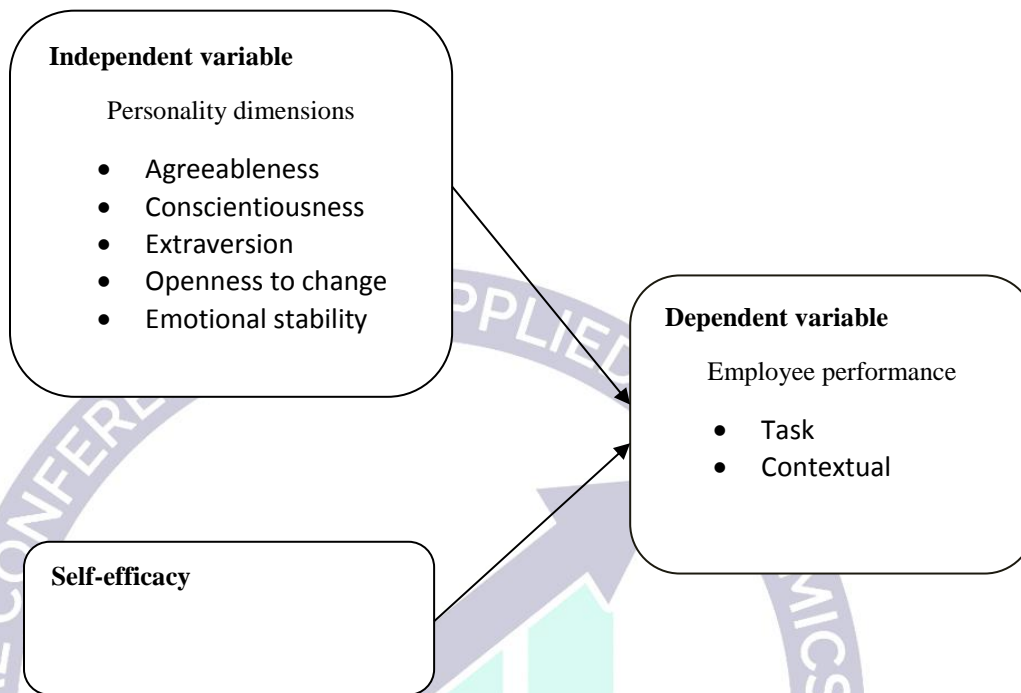
Does Self efficacy have an impact on employee's performance?

Research Hypothesis:

H1: Big five personality has a positive relationship with job performance.

H2: Self efficacy has an effect on task-contextual performance.

Research Model:



2. LITERATURE REVIEW

Individual personality and their personal features is a vital and contributory factor to put into consideration when employee's performance, because they are the underlying motivational factor that contribute to high performance, because when people are less positive about themselves, they are less likely to like their job or even organization they work for, which in the long run will have a negative effect on performance, for individual performance has a strong tie and link to organizational performance according to Rothmann, S & Cortzer Ep, (2003) he concludes that organization performance is a function of individual performance of all the employees in an organization, which makes each employees performance relevant to the organization.

2.1 The Concept of Personality

Personality is an important factor when it comes to work performance, it is a measure used in recruiting of employee into some organization, for it has its part in predicting what employee is likely able to achieve because it plays a vital role among many others factors. Personality is defined by American Psychology Association as individual differences in characteristic patterns of thinking, feeling and behaving, and social psychologist defined Personality as a dynamic and organized set of characteristics

possessed by a person that uniquely influences his or her cognitions, motivations, and behaviors in various situations.

2.2 Determinant of Personality

(Pierce & Gardener, 2002) mentions in his book that personality is acquired either by heredity (inborn traits) or environment (acquisition from external factor outside self). The two is a determining factor of personality, it precedes individual personality displays. The heredity is determined at birth, which is triggered or caused by parent donation of genes, while environment contribute to personality as a result of individual interaction with his outward environment, which happen through learning, life experience. Research in the past support that a large percentage of our personality is determined through heredity, than from environment, supported by a study of two identical twins raised in different environment from birth, but both having the same traits in their adult life, and the study of young children carried out in the university of Minnesota shows that genetics account for 50 percent of our personality differences and more than 30 percent of variation in occupation and leisure interest. (Pierce & Gardener, 2002).

2.3. Personality Dimensions

Agreeableness: is a dimension of personality that measures individual ability to accept individual differences and to be able to cooperate and integrate with another.

Conscientiousness: is a feature of personality that measures the reliability nature of a personality, how dependable, persistent and organizing individual traits.

Emotional Stability: is a facet of personality measuring the ability to stay calm, focused and keep confidence in a challenging situation.

Extraversion: is a side of personality measuring the easiness in relating with others, high level of interaction with one's environment, and outward orientation of a person.

Openness to Experience: is an attribute of a personality that measures ones range of interest to learn, explore and the inquisitiveness of a personality. (Costa & McCrae, 1992).

2.4. Self-Efficacy

(Bandura, 1997) concludes in his research, that employee's self-efficacy is a strong and a valid predictor of job performance, self-efficacy is the belief of an employee trusting in his or her strength, abilities, capabilities and competencies to achieve a particular task, it has a great influences on employee output, because effort and commitment from employee is only exercised in accordance to the employee's believe in self-abilities, and high performance of an employee is directly proportional to their level or depth of self-efficacy.

Albert Bandura said and I quote

“People’s belief about their efficacy affect the sort of choices they make in significant ways, it affects their level of motivation, perseverance in the face of obstacles. Most success requires persistent effort, so low efficacy becomes a limiting process, and in order to succeed, people need a sense of self efficacy, strung together with resilience to meet the inevitable obstacles and inequities of life”

Robbins, (2009) support the self-efficacy proposed by Bandura, (1997), by concluding that positive core self-evaluation, which has a predictive power over behavior resulting in high performance. The positive evaluation of self is what Bandura refer to as self-efficacy, where employee sees themselves as having a high sense of accomplishment, proficient and competent, and perceive self as able to perform any required tasks, unlike negative core self-evaluation, where employee see self as inadequate, inept and inexperienced, which the two stand points will alter their performance in the long run.

2.5. Job Performance

Job performance is the output of the effort employee put into their work or job process (Roe, 1999). It is multidimensional in nature, it is the efficient way in which an employee completes his or her task, with the use of self-discretion and direction, skills and resources at hand. it is how well employee do their job, how they maximize their potentials and resources and their sufficiency in acting independently. (Boshoff & Arnold, 1995)

There are two integral aspect of job performance, Borman et al, (1993), talked about which are task and contextual, stating that task performance which is also known as technical performance, is the specific role, duties, and primary task expected of a position an employee occupies, while the contextual performance are the extra roles from the employee supporting the task performance, which could be related the employee’s interaction in and between groups in the organization which is in relation to Thomas & Feldman, (2009) findings of citizenship behavioral aspect of job performance.

2.6. Self-Efficacy and Job Performance

Bandura, (1977) mentions in his studies that individual with high self-efficacy believe in their ability, which makes them exercise lot of effort and persist long in achieving high, the other way individual with low self-efficacy have a self-doubt on what they can achieve which negatively affect their performance level, and it has been found to be a determining factor for a higher performance, enhancing their outcomes, as cited by Iroegbu, M. (2015).

Self-efficacy is an individual conclusive belief on what is within their reach and achievable for them, which motivate them in high task and contextual performance, doing the actual job and going beyond outside responsibility, extending a helping hand to colleague at work, they tend to be high in citizenship behavior, self-efficacy has a strong link to what an individual can actually achieve, it foster a positive

response to work challenge encountered, while individual with low self-efficacy sees a minor challenge as an hindrance to achieving their target and goals leading to a poor or lower performance.

Olido et al, (2015). Found self-efficacy very contributory to employee's performance, he found a positive relationship between them and conclude self-efficacy a strong predictor to employee's performance. He believes that self-efficacy is the underling factor that motivate employees to act and persist in achieving their target goals, they are internally motivated to perform higher and better than when their motivation is only external, in which challenging situation can have a negative impact on their performance, high efficacious employees finds it easier to take up the responsibilities of achieving their goals, he concludes that self-efficacy is a good contributory element or factors to the variation to employee's performance.

3. METHODOLOGY

This research aims to find the effect of personality and self-efficacy on employee's performance in Nigeria higher education, research was carried out on Lagos state polytechnic staff both academic and administrative staff with total number of 200 of sample size, quantitative approach was used with stratified sampling technique, three questionnaire was use, one on personality the second on self efficacy and the third was on performance. The total of all the questionnaire items were 63 with six demographic variables, likely questionnaire items on personality is "I tend to find fault with others" on self-efficacy "when facing difficult task, I am certain that I will accomplish them" on performance "I volunteer for duties which are not my duties with my own intentions, performance has got two dimensions, which are task and contextual performance with reliability value of 0.8 while personality has got five dimensions which are extroversion, agreeableness, emotional stability, conscientiousness and openness to experience with reliability value of 0.7 and general self efficacy with reliability of 0.8. data analysis used with correlations, regression, ANOVA, and independent sample t.test.

4. DATA ANALYSIS and RESULTS

Male are 105 (52.2%) and female are 95 (47.3%). Respondent less than the age of 30 are 25 (12.4%) and those between the age of 31-40 years are 90 (44.8%), while those of 41-50 years are 61(30.3%) and 51-60 years are 24 (11.9%), Respondent tenure with 0 - 4 years are 20 (10.0%) and those between 5 - 9 years are 88 (43.8%), while those of 10 - 14 years are 47 (23.4%) and 15 - 19 years are 21 (10.4%) and those above 20 years are 24 (11.9%). Lecturers are 25 (12.4%), instructors are 18 (9.0%), technologist are 16 (8.0), senior non teaching staff are 97 (48.3%), and junior non teaching staff are 44 (21.9%). Respondent who are single are 33 (16.4%), the married are 163 (81.1%), separated is 1 (0.5), widow are 3 (1.5%). ICT are 9 (4.5%), registry 59 (29.4%), internal audit are 11(5.5%), bursary are 16 (8.0%), library are 14 (7.0%), mechanical engineering are 30 (14.9), urban and regional planning are 4 (2.0), mathematics and statistics are 13 (6.5), Marketing 4 (0.2%), insurance 2 (1.0%), health are 9 (4.5%),

works and service are 5(2.5%), hotel management and tourism, mass communication, consult, personnel, academic planning are 3(1.5%), environmental, banking and finance, science laboratory technology, fisheries technology are 1(0.5)

Table 1. Correlation between Self-Efficacy and Performance

Correlations

| | | SEF | PER |
|-----|---------------------|--------|--------|
| SEF | Pearson Correlation | 1 | .609** |
| | Sig. (2-tailed) | | .000 |
| | N | 200 | 200 |
| PER | Pearson Correlation | .609** | 1 |
| | Sig. (2-tailed) | .000 | |
| | N | 200 | 200 |

** . Correlation is significant at the 0.01 level (2-tailed).

There is a high relationship between self-efficacy and employee performance with a value of 0.6. Self-efficacy has a higher relationship with the task dimension of performance than the contextual dimension of performance, with value of 0.6 and 0.5 respectively.

Table 2. Regression Analysis of Personality and Performance

Coefficients^a

| Model | Unstandardized Coefficients | | Standardized Coefficients | t | Sig. | |
|-------|-----------------------------|------------|---------------------------|------|--------|------|
| | B | Std. Error | Beta | | | |
| 1 | (Constant) | 3.682 | .296 | | 12.441 | .000 |
| | PERF | .150 | .085 | .126 | 1.777 | .077 |

The relationship between employee personality and their performance is significant and has a high correlation, with value of 0.8 and is significant with the openness to change and extroversion dimension of personality.

Table 3. Regression Analysis of Self-Efficacy and Performance

Coefficients^a

| Model | Unstandardized Coefficients | | Standardized Coefficients | t | Sig. |
|--------------|-----------------------------|------------|---------------------------|--------|------|
| | B | Std. Error | Beta | | |
| 1 (Constant) | 2.093 | .197 | | 10.632 | .000 |
| SEF | .498 | .046 | .609 | 10.809 | .000 |

a. Dependent Variable: PER

The relationship between employee personality and their performance is significant and has a high correlation and has a predictive value of 50 percentage on performance.

5. CONCLUSION

In conclusion, employee personality is an important variable in assessing their performance on the job, as employees who believe in their abilities perform better on their job. Recommendation is that staff should be trained to increase their belief in their abilities which will also increase their performance.

REFERENCES

- Bandura, A., (1997). "Self Efficacy: Towards A Unifying Theory of Behavioral Change". *Psychology Review*, 84 (2): 191 -215
- Barrick, M., Mount, M. (1991). "The Big Five Personality Dimension and Job Performance: A Meta Analysis". *Personnel Psychology*, 44: 1 – 26.
- Gist, M. (1987). "Self-Efficacy: Implications for Organizational Behavior and Human Resource Management". *Academy Of Management Review*. 12(3): 472-485.
- Iroegbu, M. (2015). "Self-efficacy and job performance: a Theoretical Framework of Albert Bandura's Model, Review of Findings and Implication and directions for future research". *Psychology and Behavioural Science*. 4(4): 170-173
- Manasseh, N. I. (2015). "Self Efficacy and Work Performance: A Theoretical Framework of Albert Bandura's Model", *Review of Findings, Implications and Directions for Future Research*.
- Pierce, J. and Gardener, D (2002). "Management and Organizational Behaviour". OH South-Western. Thomas Learning.
- Robbin. J. (2009). "Organisation Behavior", Pearson International, 13 Editions.

ENERJİ-BÜYÜME İLİŞKİSİ: TÜRKİYE-GÜNEY KORE ANALİZİ

Dr.Öğr. Üyesi Sefer UÇAK*

ÖZET

Enerji kaynakları yetersiz ülkeler, ekonomik büyüme için üretim artışı sağlayacak petrol ve doğalgaz gibi fosil kaynaklı enerji ihtiyaçlarını ithalat ile karşılamaktadırlar. Fosil yakıtlara dayalı üretim sistemi çevresel sorunları beraberinde getirmekte ve ülkenin dışa bağımlı hale gelmesine neden olmaktadır. Fakat üretim ve tüketim için gerekli olan enerji ihtiyacını yenilenebilir kaynaklardan ziyade yaklaşık toplam üretimin % 70 gibi bir oranda fosil yakıtlardan elde etmektedirler.

Bu çalışmada, enerjide dışa bağımlı olan OECD üyesi Türkiye ve G.Kore için 1971-2017 yıllarında petrol, doğalgaz, kömür kaynaklı elektrik enerjisi üretiminin (% toplam) büyümeye (reel GSYH artış oranı) katkısı karşılaştırmalı olarak incelenmiştir. Elektrik üretimi ve büyüme arasındaki ilişki serilerin $I(1)$ ve $I(0)$ olmalarından dolayı ARDL sınır testi ile incelenmiştir. Seriler arasında eşbütünleşme ilişkisinin yönü (F istatistiği'ne göre), elektrik üretiminden büyümeye doğrudur. Büyümeden enerjiye doğru ise ilişki tespit edilememiştir. G.Kore ve Türkiye için ARDL(1,2) ile ARDL(4,3) modelleri uygun bulunmuştur. Türkiye için enerji değişkeninin olasılık değerinin 0,05'den küçük olması nedeniyle enerji değişkenindeki artış, uzun dönemde büyüme üzerinde(0,094) pozitif etkiye neden olmaktadır. G.Kore için olasılık değerinin 0,41 olması uzun dönemli anlamlı bir ilişkinin olmadığını göstermektedir. Türkiye'de enerjide %1'lik artış, kısa dönemde büyümeyi %0,20 arttıracaktır. G.Kore'de enerjide %1'lik artış, kısa dönemde büyümeyi %0,25 arttıracaktır.

Anahtar Kelimeler: Enerji, Büyüme, Türkiye, G. Kore, ARDL

JEL Kodları: Q30, Q32, C12.

THE RELATIONSHIP BETWEEN ENERGY-GROWTH: ANALYSES OF TURKEY AND SOUTH KOREA

ABSTRACT

Countries with insufficient energy resources meet their fossil-derived energy needs, such as oil and natural gas, with an increase in production for economic growth. The production system based on fossil fuels brings about environmental problems and causes the country to become dependent on foreign

* Balıkesir Üniversitesi, Sındırgı MYO, Dış Ticaret Programı, seferucak@balikesir.edu.tr ORCID: 0000-0002-9251-9584

sources. However, the energy requirement for production and consumption is derived from fossil fuels at a rate of 70% of total production rather than renewable resources.

In this study, the OECD members who are dependent on foreign energy oil in the 1971-2017 year for Turkey and South Korea, natural gas, coal sourced electricity production (% of total) growth (real GDP growth rate) contribution were comparatively investigated. The relationship between electricity generation and growth was investigated by ARDL boundary test because of the series I (1) and I (0). The direction of the cointegration relationship between series (according to the F statistic) is towards growth from electricity production. The relationship between growth and energy could not be determined. South Korea and ARDL for Turkey (1,2) with ARDL (4,3) model have been found suitable. energy variable probability value of less than 0.05 due to the increase in energy variables for Turkey, on growth in the long term (0,094) causes a positive effect. The probability value for S. Korea is 0,41, indicating that there is no significant long-term relationship. A 1% increase in energy in Turkey will increase 0.20% growth in the short term. The 1% increase in energy in S. Korea will increase the growth by 0.25% in the short term.

Keywords: Energy, Growth, Turkey, S. Korea, ARDL

JEL Codes: Q30, Q32, C12

1.GİRİŞ

Enerji, üretim ve tüketim sürecinde günümüzde en önemli girdi olmaktadır. Enerji kaynakları yetersiz ülkeler, ekonomik büyüme için üretim artışı sağlayacak petrol ve doğalgaz gibi fosil kaynaklı enerji ihtiyaçlarını ithalat ile karşılamaktadırlar. Fosil yakıtlara dayalı üretim sistemi çevresel sorunları beraberinde getirmekte ve ülkenin dışa bağımlı hale gelmesine neden olmaktadır. Fakat, üretim ve tüketim için gerekli olan enerji ihtiyacını yenilenebilir kaynaklardan ziyade yaklaşık toplam üretimin % 70 gibi bir oranda fosil yakıtlardan elde etmektedirler.

1970 ve 1980'lerde aynı ekonomik gelişme düzeyine ve benzer kişi başı GSYH'ya sahip olan Türkiye ve G. Kore'nin 90'lardan itibaren ayrışarak, G.Kore'nin Türkiye'nin üç katı kadar bir gelir düzeyine ulaşması farklı nedenlerden olmaktadır. Ekonomik büyüme süreçleri ortak bir zamana sahip olan Türkiye ve G. Kore enerjide dış kaynaklara bağımlıdır. Özellikle elektrik enerjilerinin üretim kompozisyonların bakıldığında; her iki ülkenin de yaklaşık yüzde 68'ini fosil yakıt kaynaklı girdilerden elde ettiği Tablo 1 ve 2'de görülmektedir. Fakat G. Kore'nin Türkiye'den farkı 1970'lerden itibaren nükleer enerji kaynaklı elektrik üretimi yapmasıdır. Toplam elektrik üretiminin yaklaşık %30'unu nükleer enerjiden elde etmektedir. Türkiye'de ise yenilenebilir kaynaklardan elektrik üretiminin payı yaklaşık %6.5 seviyelerindedir.

Tablo 1. Güney Kore Elektrik Üretimi Dağılımı

| Elektrik dağılımı (%) | 1971 | 1980 | 1990 | 2000 | 2010 | 2017 |
|---------------------------|------|------|------|------|------|------|
| Nükleer/Toplam | 0,26 | 9,3 | 50,3 | 37,7 | 29,9 | 30,1 |
| Yenilenebilir/Toplam | - | - | - | 0,03 | 0,5 | 1,5 |
| Petrol, Gaz, Kömür/Toplam | 87,4 | 85,3 | 43,7 | 60,8 | 68,7 | 69,5 |
| Hidro/Toplam | 12,5 | 5,4 | 6,0 | 1,4 | 0,74 | 0,4 |
| Toplam | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 |

Kaynak: Dünya Bankası, İstatistikler, <https://data.worldbank.org/indicator/NY.GDP.MKTP.CD?locations=KR>

Özellikle elektrik enerjilerinin üretim kompozisyonların bakıldığında; her iki ülkenin de yaklaşık yüzde 68'ini fosil yakıt kaynaklı girdilerden elde ettiği Tablo 1 ve 2'de görülmektedir. Fakat G.Kore'nin Türkiye'den farkı 1970'lerden itibaren nükleer enerji kaynaklı elektrik üretimi yapmasıdır. Toplam elektrik üretiminin yaklaşık %30'unu nükleer enerjiden elde etmektedir.

Tablo 2. Türkiye Elektrik Üretimi Dağılımı

| Elektrik dağılımı (%) | 1971 | 1980 | 1990 | 2000 | 2010 | 2017 |
|---------------------------|------|------|------|------|------|------|
| Yenilenebilir/Toplam | 1,7 | 0,6 | 0,2 | 0,3 | 1,9 | 6,4 |
| Petrol, Gaz, Kömür/Toplam | 71,6 | 50,6 | 59,6 | 75,0 | 73,5 | 70,0 |
| Hidro/Toplam | 26,6 | 48,7 | 40,2 | 24,7 | 24,5 | 23,6 |
| | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 |

Kaynak: Dünya Bankası, İstatistikler, <https://data.worldbank.org/indicator/NY.GDP.MKTP.CD?locations=TR>

Tablo 2'ye göre, Türkiye'nin elektrik üretiminde önemli bir payı G. Kore'den farklı olarak hidroelektrik almaktadır. Türkiye yenilenebilir kaynaklardan elektrik üretiminin payını %6.5 seviyelerine ulaştırarak fosil yakıt bazlı üretimi azaltmayı (kurulacak olan nükleer santraller ile birlikte de) hedeflemiştir.

Tablo 3. Türkiye ve G.Kore Temel Bazı Göstergeler

| | | 1971 | 1980 | 1990 | 2000 | 2010 | 2017 |
|--|---------|------|------|-------|-------|-------|-------|
| Kişibaşı GSYH (cari fiyatlarla)milyon dolar | Türkiye | 455 | 1564 | 2794 | 4316 | 10672 | 10540 |
| | G.Kore | 300 | 1704 | 6516 | 11947 | 22086 | 29742 |
| Nüfus | Türkiye | 35,7 | 43,9 | 53,9 | 63,2 | 72,3 | 80,7 |
| | G.Kore | 32,8 | 38,1 | 42,8 | 47,0 | 49,5 | 51,4 |
| Yüksek Tek.Ürün İhracatı/Toplam ihracat (%) | Türkiye | - | - | 1,21 | 4,82 | 1,93 | 2,04 |
| | G.Kore | - | - | 18,03 | 35,06 | 29,4 | 26,5 |
| Enerji ithalatı/Toplam enerji kullanımı (%) | Türkiye | 29,3 | 45,5 | 51,03 | 65,9 | 69,6 | 75,2 |
| | G.Kore | 62,4 | 77,5 | 75,6 | 81,7 | 82,01 | 81,4 |

Kaynak: Dünya Bankası, İstatistikler, <https://data.worldbank.org/indicator/NY.GDP.MKTP.CD?locations=KR>
<https://data.worldbank.org/indicator/NY.GDP.MKTP.CD?locations=TR>

Enerji tüketimi ile büyüme arasındaki nedensellik ilişkisi dört türlü ele alınmaktadır (Mehra, 2007:2940, Uçak, Usupbeyli, 2015:770-771):

Yansızlık hipotezine göre (nedensellik yok); enerji tüketimini arttırıcı yönde çabalar ekonomik büyüme üzerinde etkiye neden olmayacak, enerji tüketimi ile ilgili vergi teşvikleri ve genişlemeci politikalar büyümeyi etkilemeyecektir.

Büyüme hipotezinde (enerjiden büyümeye tek yönlü nedensellik); enerjide etkinlik sağlayacak yatırımlar, yeni verimli teknikler ve alternative enerji çabaları ekonomik büyüme üzerinde etkili olurken, enerji tüketiminin azaltılması ekonomik büyümeyi azaltacaktır.

Geribildirim hipotezinde (çift yönlü nedensellik); enerji tüketimindeki azalış büyümeyi azaltırken, büyüme hipoteziyle aynı politikalar sağlıklı sonuç verecektir.

Koruma hipotezinde (büyümeden enerjiye tek yönlü nedensellik); ekonomik büyüme enerji tüketimini etkileyecek fakat, korumacı politikalar büyüme üzerinde etkiye neden olmayacaktır.

Elektrik tüketimi ile ekonomik büyüme arasındaki ilişkinin yönü, ülkelerin doğru enerji politikaları üretmeleri yolunda yol gösterici olabilecektir. Böylece ülkeler kendi enerji talep ve arzının yönünü doğru olarak tespit ederek uzun dönemde büyüme için en sağlıklı katkıyı sağlayabileceklerdir.

2.LİTERATÜR

Elektrik tüketimi ve büyüme ilişkisinin ele alındığı çalışmalar özellikle 1990'lardan itibaren yapılmaya başlanmıştır. Payne (2010), çeşitli nedensellik ilişkilerini ele alarak elektrik tüketimi-büyüme literatürünü incelediği çalışmada; incelediği makalelerin %31,15'nin yansızlık (neutrality) hipotezini, %27.87'sinin koruma (conservation) hipotezini %22.95'nin büyüme (growth) hipotezini, %18.03'nün ise geribildirim (feedback) hipotezini desteklediği sonucuna ulaşmıştır.

Altınay ve Karagöl (2005), 1950-2000 dönemi verileriyle Türkiye için yaptıkları çalışmada elektrik tüketiminden ekonomik büyümeye doğru tek yönlü nedensellik bulmuşlardır. Elektrik tüketiminden ekonomik büyümeye doğru tek taraflı bir nedensellik, elektrik kullanımındaki kısıtlamaların ekonomik büyümeyi olumsuz olarak etkileyeceğini; elektrik tüketim artışının ekonomik büyümeye uzun dönemde katkı yapacağını göstermektedir.

Tablo 4. Literatür Özeti

| Yazar | Yöntem | Dönem | Ülkeler | Nedensellik ve Sonuç |
|-----------------------------------|---|-------------|--|--|
| Glasure, Lee (1997) | Eşbütünleşme ve ECM | 1961 - 1990 | G.kore , Singapur | Eşbütünleşme ve ECM'ye göre; GSYH↔ET G.Kore ve Singapur Granger'a göre; GSYHxET G.Kore GSYH→ET Singapur |
| Soytas ve Sari (2003) | Granger nedensellik ve ECM | 1950-1992 | Arjantin, İtalya, G.Kore, Türkiye, Fransa, Almanya, Japonya | EÜR↔EB EB→EÜR EÜR→EB |
| Oh ve Lee (2004) | Granger nedensellik ve ECM | 1970-1999 | Kore | EÜR↔EB |
| Chen, Kuo, Chen (2007) | ECM Panel eşbütünleşme Nedensellik | 1971-2001 | Çin, Endonezya, Kore, Hindistan, Malezya, Tayvan, Filipinler, Singapur, Tayland, Hong Kong | Kısa Dönemde EB→EÜR Uzun dönemde EÜR↔EB |
| Özata (2010) | Nedensellik, Eşbütünleşme, Vektör hata düzeltme modeli | 1970-2008 | Türkiye | Reel GSMH ve enerji tüketimi arasında eşbütünleşme ilişkisi Reel GSMH→ enerji tüketimi |
| Polat, Uslu ve San (2011) | ARDL ve Granger Nedensellik testi | 1950-2006 | Türkiye | Uzun dönemde istihdam → reel GSMH elektrik tüketiminden →reel GSMH kısa dönemde istihdam→ elektrik tüketimi |
| Ertuğrul (2011) | Eş Bütünleşme, Kalman Filtresi | 1998-2011 | Türkiye | Elektrik tüketiminin GSYH'da 2003'ten itibaren artan etkisi olduğu Küresel krizin etkisiyle 2009'dan azalmaya başlayan ilişki, 2011'den artmaya başladığı bulunmuştur. |
| Yapraklı ve Yurttaçıkılmaz (2012) | Eş Bütünleşme, Hata Düzeltme-Geliştirilmiş Granger Nedensellik Analizi | 1970-2010 | Türkiye | elektrik tüketimi ↔ekonomik büyüme |
| Saatçi ve Dumrul (2013) | Dinamik En Küçük Kareler Yöntemi (DOLS) Düzeltilmiş En Küçük Kareler Yöntemi(FMOLS) | 1960-2008 | Türkiye | Uzun dönemde, elektrik tüketimindeki %1'lik artış ekonomik büyümeyi %0.33-%0.37 oranında artıracaktır. |
| Altıntaş ve Koçbulut (2014) | Eş Bütünleşme, ARDL, Granger nedensellik testleri | 1960-2011 | Türkiye | Elektrik tüketimi → GSMH |
| Erdoğan ve Gürbüz (2014) | Eşbütünleşme, Nedensellik | 1970-2009 | Türkiye | Reel GSYH→sermaye, enerji tüketimi→ sermaye, ihracat→ Reel GSYH, ihracat→ enerji tüketimi ihracattan→ sermayeye enerji tüketimi X ekonomik büyüme |

| Yazar | Yöntem | Dönem | Ülkeler | Nedensellik ve Sonuç |
|------------------------|--|-----------|---------|--|
| İsmiç (2015) | Swamy'nin Tesadüfi Katsayılar Modeli ve Görünüşte İlişkisiz Regresyon(SUR) modelleri | 1990-2012 | Türkiye | Ekonomik büyümenin elektrik tüketimi üzerinde pozitif etkisi gözlemlenmiş, nüfusun elektrik tüketimi üzerinde etkisi olmadığı bulunmuştur. |
| Dogan (2015) | ARDL | 1990–2012 | Türkiye | Kısa dönemde enerji tüketimi-büyüme arasında yansızlık hipotezi; uzun dönemde geribildirim hipotezi |
| Savaş ve Durğun (2016) | Nedensellik | 1980-2010 | Türkiye | Elektrik tüketimi → GSMH |

Tablo 4'te literatür sonuçları, Türkiye açısından incelendiğinde özellikle enerji tüketiminden büyümeye tek yönlü nedensellik ilişkisinin ağırlıkta olduğu ekonometrik sonuçlar göze çarpmaktadır. Buna göre, gelişmekte olan diğer ülkelerde olduğu gibi Türkiye içinde büyüme hipotezinin geçerli olduğu birçok akademik çalışmada görülmektedir.

3. VERİ VE YÖNTEM

Çalışmada 1971-2017 yılları arasında Türkiye ve G.Kore elektrik üretiminin (petrol, doğalgaz, kömür) toplam elektrik üretimi içindeki payı (EÜR) ile reel GSYH büyüme oranı (B) arasındaki ilişki incelenmiştir. Kullanılan değişkenlerin verileri Dünya Bankası veri tabanından elde edilmiştir. Elektrik üretimi ile ekonomik büyüme arasında uzun dönemli bir ilişki olup olmadığının test edilmesi için sınır testi kullanılırken, uzun ve kısa dönem ilişkisinde ARDL kullanılmıştır. Değişkenler arasındaki ilişkinin açıklanmasında bu yöntemin seçilmesinin nedenleri; değişkenlerin bütünleşme derecelerinin farklı olduğu durumlarda da (I(0) ve I(1)) ilişkinin araştırılabilmesi ve küçük örneklerde de etkili sonuçlar verebilmesidir (Peseran vd. 2001).

Tablo 5. Serilerin Birim Kök Testi Sonuçları (Trend ve kesme terimli)

| DEĞİŞKEN | DÜZEY | | | | | | |
|---------------------------|--|------------------|-----------|----------------|---------------|---------------|--|
| | TÜRKİYE | | | G.KORE | | | |
| ELEKTRİK ÜRETİMİ (EÜR) | | ADF | | PP | ADF | PP | |
| | t-istatistiği | -3.401897 [0]* | | -3.254913 [0]* | -1.464218[1]* | -1.354552[3]* | |
| | Olasılık | 0.0636** | | 0.0868** | 0.8272** | 0.8610** | |
| | Kritik Değer | % 1 | -4.170583 | -4.170583 | -4.170583 | -4.170583 | |
| | | %5 | -3.510740 | -3.510740 | -3.510740 | -3.510740 | |
| | | %10 | -3.185512 | -3.185512 | -3.185512 | -3.185512 | |
| | | I.FARKLAR | | | | | |
| | | ADF | | PP | ADF | PP | |
| | t-istatistiği | -6.186057 [1]* | | -9.544386 [10] | -5.228287[0]* | -5.197747[2]* | |
| | Olasılık | 0.0000** | | 0.0000** | 0.0005 | 0.0006 | |
| Kritik Değer | % 1 | -4.180911 | -4.175640 | -4.175640 | -4.175640 | | |
| | %5 | -3.515523 | -3.513075 | -3.513075 | -3.513075 | | |
| | %10 | -3.188259 | -3.186854 | -3.186854 | -3.186854 | | |
| Reel GSYH (B) | | DÜZEY | | | | | |
| | | ADF | | PP | ADF | PP | |
| | t-istatistiği | -6.547094 [0]* | | -6.542498 [3] | -6.510204 [0] | -6.565221 [6] | |
| | Olasılık | 0.0000** | | 0.0000** | 0.0000** | 0.0000** | |
| | Kritik Değer | % 1 | -4.170583 | -4.170583 | -4.170583 | -4.170583 | |
| | | %5 | -3.510740 | -3.510740 | -3.510740 | -3.510740 | |
| | | %10 | -3.185512 | -3.185512 | -3.185512 | -3.185512 | |
| | * Uygun gecikme uzunluklarını vermektedir. ADF testinde Akaike Bilgi Kriteri, PP testinde Barlett Kernel için Newey-West Bandwidth değeridir. | | | | | | |
| | ** ADF ve PP için olasılık değeri, 0.05'ten büyük ise H ₀ hipotezi (H ₀ :Seri durağan değildir) kabul edilir, seri durağan değildir. Olasılığın 0.05'ten küçük olduğu durumda H ₀ hipotezi reddedilir, seri durağandır. | | | | | | |

Eşbütünlüşme ilişkisinin araştırılmasına geçilmeden önce EÜR ve Y serilerinin durağanlıklarının belirlenmesinde ADF ve PP birim kök testleri uygulanmıştır. Birim kök test sonuçları Tablo 2'de verilmiştir. Buna göre Türkiye ve G.Kore için EÜR serisinin birinci farkı aldığıında durağan olduğu [I(1)], B serisinin ise düzeyde durağan olduğu [I(0)], tespit edilmiştir. Bu nedenle serilerin aralarındaki eşbütünlüşme ilişkisinin araştırılmasında ARDL (Autoregressive-Distributed Lag) yöntemini kullanılacaktır.

3.1.ARD L ve Sınır Testi

Bu çalışmada uzun ve kısa dönem; elektrik üretimi/ toplam elektrik üretimi(EÜR) (%) ile Reel GSYH(B) Büyüme Oranı (%) ilişkisinin durağan durum dengesi ARDL modeli ile araştırılmıştır. Kurulan modeldeki eşbütünlüşme ilişkisinin belirlenmesinde aşağıda yer alan Denklem (1) kullanılmıştır.

$$\Delta B_t = \alpha_0 + \sum_{i=1}^m \alpha_{1i} \Delta B_{t-i} + \sum_{i=1}^m \alpha_{2i} \Delta EÜR_{t-i} + \alpha_3 B_{t-1} + \alpha_4 EÜR_{t-1} + u_t \quad (1)$$

Kurulan modelde değişkenlerin bağımlı ve bağımsız değişken olarak alındığı denklemler arasındaki ilişki araştırılarak, hem nedensellik ilişkisi hem de eşbütünlüşme test edilecektir. EÜR'nin

bağımsız değişken olduğu durum için kurulan ekonometrik model Denklem (2)'de, Y'nin bağımsız değişken olduğu durum için kurulan ekonometrik model ise Denklem (3)'de verilmektedir.

$$\text{Model 1: } B_t = \alpha_0 + \alpha_1 E\ddot{U}R_t + \varepsilon_t \quad (2)$$

$$\text{Model 2: } E\ddot{U}R_t = \beta_0 + \beta_1 B_t + \varepsilon_t \quad (3)$$

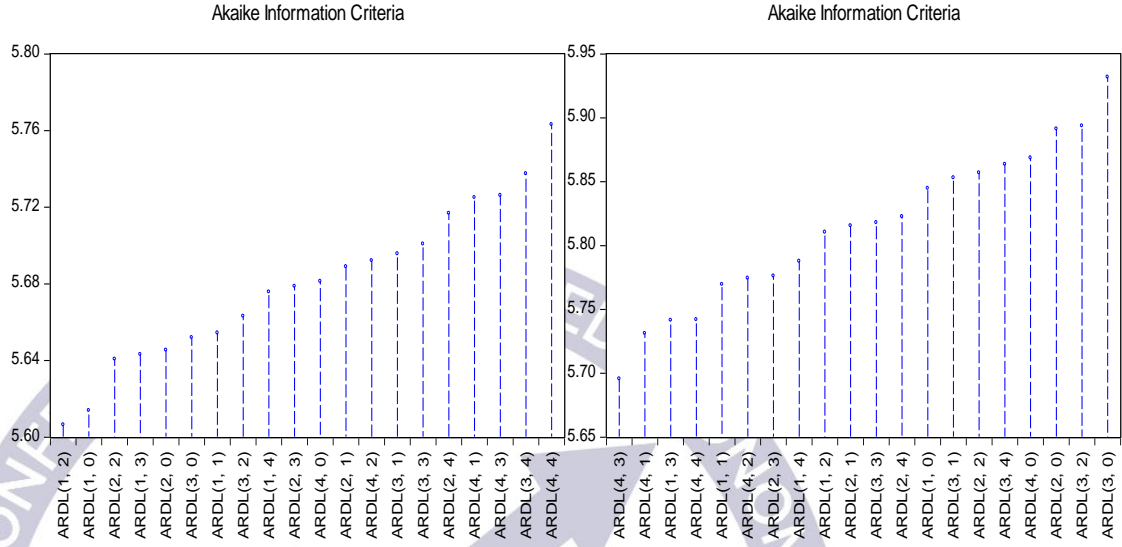
ARDL modelleri kurulurken eşbütünlük ilişkisinin olup olmadığının araştırılması için sınır testi (bound test) yapılmaktadır. Bu çalışmada sınır testi yapılırken F sınır testi (Wald test) uygulanmıştır.

Tablo 6. F Sınır Testi Sonuçları

| Türkiye | | | G.Kore | | |
|-----------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| Model 1:F İstatistiği | 8.423735 | k=1 | | 6.909214 | k=1 |
| Model 2:F İstatistiği | 2.343293 | k=1 | | 1.195353 | k=1 |
| Anlamlılık Düzeyi | Alt Kritik Sınır | Üst Kritik Sınır | AnlamlılıkDüzeyi | Alt Kritik Sınır | Üst Kritik Sınır |
| 10% | 3.02 | 3.51 | 10% | 3.02 | 3.51 |
| 5% | 3.62 | 4.16 | 5% | 3.62 | 4.16 |
| 2.5% | 4.18 | 4.79 | 2.5% | 4.18 | 4.79 |
| 1% | 4.94 | 5.58 | 1% | 4.94 | 5.58 |

Tablo 6'da görüldüğü gibi, Türkiye ve G.Kore için Sınır Testi sonucunda Model 1 için F test istatistiğinin (8.42 ve 6.90) anlamlılık düzeylerine göre alt ve üst sınır değerlerinin üzerinde olduğundan eşbütünlük ilişkisi vardır. Seriler arasında nedenselliğin yönü denklemsel ilişkiden dolayı EÜR değişkeninden B değişkenine doğrudur. Model 2 için test istatistiği değerinin (2.34 ve 1.19) anlamlılık düzeylerinde alt ve üst kritik sınırların altında kaldığından seriler arasında eşbütünlük ilişkisi tespit edilememiştir.

Şekil 1. Seçilen ARDL Modeli (Akaike Bilgi Kriterine Göre)



Bu sonuçlara göre, kurulan Türkiye ve G.Kore Model 1 için gecikme uzunlukları; AIC (Akaike), BIC (Bayes) ile HQ (Hannan-Quinn) bilgi kriterleri ile incelenmiştir. Akaike bilgi kriterine göre Şekil 1'de görüldüğü gibi G.Kore için ARDL(1,2), Türkiye için ARDL(4,3) modeli en düşük bilgi kriteri değerini sağlamıştır.

3.2.Eşbütünleşme İlişkisinin Araştırılması ve Uzun Dönem Katsayıları

ARDL modellerinde eş bütünleşme ilişkisinin varlığının araştırılması için sınır testi ile hata düzeltme modeli (UECM, Unrestricted Error Correction Model) kurulmaktadır.

Tablo 7. G.Kore ARDL(1,2) Modeli Tahmin Sonuçları

| Değişkenler | Katsayı | St.hata | t istatistiği | Olasılık |
|---|-----------|-----------------------|-----------------|------------------------|
| $G_KORE_GDP(-1)$ | 0.357033 | 0.142234 | 2.510186 | 0.0162 |
| G_KORE_EÜR | 0.049929 | 0.131679 | 0.379175 | 0.7066 |
| G_KORE_EÜR(-1) | -0.263750 | 0.200042 | -1.318476 | 0.1948 |
| $G_KORE_EÜR(-2)$ | 0.248872 | 0.128914 | 1.930531 | 0.0607 |
| C | 1.938353 | 2.998104 | 0.646526 | 0.5216 |
| Tamsal Özellikler | | R ² : 0,22 | | |
| Test | | Değer | Olasılık | Sonuç |
| Jarque- Bera χ^2_{JB} | | 6,3057 | 0,0687* | Normallik sağlandı |
| Breusch-Godfrey LM- χ^2_{BG} | | 0,0235 | 0,9903* | Otokorelasyon yok |
| Breusch-Pagan-Godfrey χ^2_{BPG} | | 1,0134 | 0,4120* | Sabit varyanslılık var |
| *Test olasılık değerlerinin 0.0.5 ten büyük olması varsayımların sağlandığını göstermektedir. | | | | |

Tablo 8. Türkiye ARDL (4,3) Modeli Tahmin Sonuçları

| Değişkenler | Katsayı | St.hata | t istatistiği | Olasılık |
|---|-----------|----------|---------------|------------------------|
| TR_GDP(-1) | 0.052803 | 0.149840 | 0.352397 | 0.7267 |
| TR_GDP(-2) | -0.096999 | 0.150187 | -0.645855 | 0.5227 |
| TR_GDP(-3) | -0.065448 | 0.142496 | -0.459299 | 0.6489 |
| TR_GDP(-4) | -0.356408 | 0.142470 | -2.501629 | 0.0173 |
| TR_EÜR | -0.141634 | 0.087097 | -1.626169 | 0.1131 |
| TR_EÜR(-1) | 0.254519 | 0.104705 | 2.430823 | 0.0205 |
| TR_EÜR(-2) | -0.166271 | 0.109731 | -1.515252 | 0.1390 |
| TR_EÜR(-3) | 0.191966 | 0.090074 | 2.131197 | 0.0404 |
| C | -4.965278 | 4.369356 | -1.136386 | 0.2637 |
| Tanımsal Özellikler R ² : 0,35 | | | | |
| Test | | Değer | Olasılık | Sonuç |
| Jarque- Bera χ^2_{JB} | | 3,5065 | 0,1732* | Normallik sağlandı |
| Breusch-Godfrey LM- χ^2_{BG} | | 1,0038 | 0,3777* | Otokorelasyon yok |
| Breusch-Pagan-Godfrey χ^2_{BPG} | | 1,6783 | 0,1398* | Sabit varyanslılık var |
| *Test olasılık değerlerinin 0.0.5 ten büyük olması varsayımların sağlandığını göstermektedir. | | | | |

Tablo 7'de G.Kore ve Tablo 8'de Türkiye için ARDL(1,2) ile ARDL(4,3) modelleri tahmin sonuçları en düşük bilgi kriterini veren modelin uygunluğunun belirlenmesi için otokorelasyon, normallik, değişen varyans sınamaları yapılmış ve modelin uygun olduğuna karar verilmiştir.

3.3.Uzun Dönem ve Kısa Dönem İlişki

Büyümenin bağımlı değişken ve elektrik üretiminin toplam içindeki payının bağımsız değişken olduğu modelde uzun dönem katsayıları Tablo 9 ve 10'da verilmiştir.

Tablo 9. Türkiye Uzun Dönem Katsayıları

| Değişkenler | Katsayı | t-istatistiği | Olasılık Değeri |
|-----------------|-----------|---------------|-----------------|
| EÜR | 0.094526 | 2.094402 | 0.0438 |
| C (Sabit Terim) | -3.386835 | -1.144395 | 0.2605 |

Tablo 10. G.Kore Uzun Dönem Katsayıları

| Değişkenler | Katsayı | t-istatistiği | Olasılık Değeri |
|-----------------|----------|---------------|-----------------|
| EÜR | 0.054516 | 0.828891 | 0.4121 |
| C (Sabit Terim) | 3.014700 | 0.664019 | 0.5105 |

Tablo 9 ve 10'daki katsayılar incelendiğinde; Türkiye için EÜR değişkeninin olasılık değerinin 0,05 olasılık düzeyinden küçük olması uzun dönemde değişkenler arasında anlamlı bir ilişkinin olduğunu göstermektedir. EÜR değişkenindeki artış, uzun dönemde çok küçük düzeyde de olsa(0,094) büyüme üzerinde pozitif etkiye neden olmaktadır. G.Kore için olasılık değerinin 0,41 olması uzun dönemli anlamlı bir ilişkinin olmadığını göstermektedir.

Değişkenler arasındaki kısa dönemli ilişki hata düzeltme modeline dayalı olarak tahmin edilmiştir. Hata düzeltme modeli Denklem 4'deki şekilde tahmin edilmiştir.

$$\Delta B = \alpha_0 + \sum_{i=1}^m \alpha_i \Delta B_{t-i} + \sum_{i=1}^n \Delta EÜR_{t-i} + \delta ECT_{t-1} + \varepsilon_t \quad (4)$$

Tablo 11. Kısa Dönem Katsayıları(Türkiye)

| Değişkenler | Katsayı | t-istatistiği | Olasılık Değeri |
|-------------|---------|---------------|-----------------|
| DEÜR | 0,1996 | 2,2628 | 0,0301 |
| ECT_{t-1} | -1,4660 | -5,1727 | 0,0000 |

Tablo 12. Kısa Dönem Katsayıları(G.Kore)

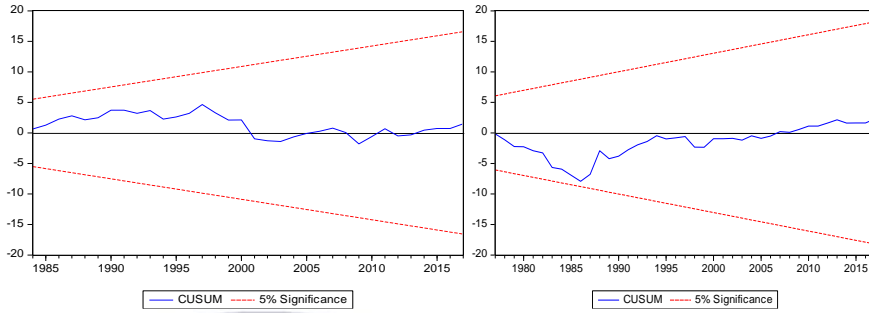
| Değişkenler | Katsayı | t-istatistiği | Olasılık Değeri |
|-------------|---------|---------------|-----------------|
| DEÜR | 0,2488 | 2,0090 | 0,0500 |
| ECT_{t-1} | -0,6429 | -4,6651 | 0,0000 |

Tablo 11'deki katsayılar incelendiğinde Türkiye'de elektrik üretimin toplam elektrik üretimi içindeki payında meydana gelen %1'lik bir artışın kısa dönemde büyümeyi %0,20 arttıracığı görülmektedir.

Tablo 12'deki katsayılar incelendiğinde G.Kore'de elektrik üretimin toplam elektrik üretimi içindeki payında meydana gelen %1'lik bir artışın kısa dönemde büyümeyi %0,25 arttıracığı görülmektedir.

Denklem 4'te yer alan hata düzeltme terimidir ve uzun dönem modelinden elde edilen kalıntıların bir dönem gecikmeli değerini göstermektedir. Hata düzeltme terimi katsayısı uzun dönemde uyarlanma hızını göstermekte ve bu katsayının istatistiksel olarak anlamlı olması ve negatif işaretli olması beklenmektedir. Tablo 7'deki sonuçlar kısa dönem hata düzeltme modeli katsayılarını göstermektedir. Buna göre hata düzeltme terimi katsayısı beklendiği gibi istatistiksel olarak anlamlı ve negatif değer almıştır. Tablodaki elektrik üretimi değişkeninin katsayısının istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif olması elektrik üretiminin büyüme üzerinde kısa dönemde de pozitif etkisi olduğunu göstermektedir.

Şekil 2. Türkiye ve G.Kore için CUSUM Sonuçları



Uzun dönem katsayılarının istikrarlı olup olmadığını göstermek için uygulanan CUSUM grafikleri Şekil 2'de gösterilmiştir. Buna göre, uzun dönem modelinin kalıntılarının birikimli toplamalarının %5 kritik çizgi aralıkları içinde yer almaktadır. Böylece modelin katsayılarının istikrarlı olduğu görülmektedir.

4.SONUÇ

Bu çalışmada aynı dönemde ortak bir kalkınma hamlesi ile benzer bir geçmişe sahip ancak farklı büyüme politikalarına ulaşmış Türkiye ve G.Kore için 1971-2017 arası dönemde yenilenebilir elektrik üretiminin toplam elektrik üretimi içindeki payı ile reel GSYH büyüme oranı arasındaki ilişki incelenmiştir. Yapılan birim kök testleri sonucunda serilerin farklı dereceden durağan olmaları nedeniyle bu ilişki ARDL modeli ile analiz edilmiştir. ARDL modeli sınır testi sonuçlarına göre B ve EÜR değişkenleri uzun dönemde eşbütünleşik olarak hareket etmektedirler. Bu ilişki F istatistiği (Wald test) sonuçlarına göre, elektrik üretiminden büyümeye doğrudur. Dolayısıyla değişkenler arasında elektrik üretiminden büyümeye doğru tek-yönlü nedensellik ilişkisinden söz edilebilir. Anılan dönemde büyümeden enerjiye doğru bir nedensellik tespit edilememiştir. G.Kore ve Türkiye için ARDL(1,2) ile ARDL(4,3) modelleri uygun bulunmuştur. Türkiye için EÜR değişkeninin olasılık değerinin 0,05 olasılık düzeyinden küçük olması nedeniyle EÜR değişkenindeki artış, uzun dönemde çok küçük düzeyde de olsa (0,094) büyümeye üzerinde pozitif etkiye neden olmaktadır. G.Kore için olasılık değerinin 0,41 olması uzun dönemli anlamlı bir ilişkinin olmadığını göstermektedir. Türkiye'de elektrik üretiminin toplam elektrik üretimi içindeki payında meydana gelen %1'lik bir artışın kısa dönemde büyümeyi %0,20 arttıracığı görülmektedir. G.Kore'de elektrik üretiminin toplam elektrik üretimi içindeki payında meydana gelen %1'lik bir artışın kısa dönemde büyümeyi %0,25 arttıracığı görülmektedir. Uzun dönem modelinin kalıntılarının birikimli toplamalarının %5 kritik çizgi aralıkları içinde yer aldığından katsayılar istikrarlıdır.

Türkiye için anılan dönemde kısa ve uzun dönemde büyüme hipotezi geçerli iken, G.Kore için kısa dönemde büyüme hipotezi desteklenirken uzun dönemde yansızlık hipotezi geçerli olmaktadır.

KAYNAKÇA

- Altınay, G. ve Karagöl, E. (2005) “Electricity Consumption and Economic Growth: Evidence from Turkey”, *Energy Economics*, 27(6): 849-856.
- Altıntaş, H., ve Koçbulut, Ö. (2014). “Türkiye’de Elektrik Tüketiminin Dinamikleri ve Ekonomik Büyüme: Sınır Testi ve Nedensellik Analizi”. *Erciyes Üniversitesi İİBF Dergisi*, 43: 37-65.
- Chen, S. T., Kuo, H. I., ve Chen, C. C. (2007). “The Relationship between GDP and Electricity Consumption in 10 Asian Countries”. *Energy Policy*, 35(4): 2611-2621.
- Dogan, E. (2015). “The Relationship Between Economic Growth and Electricity Consumption From Renewable and Non-Renewable Sources: A Study of Turkey”. *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 52: 534-546.
- Dünya Bankası, İstatistikler, <https://data.worldbank.org/indicator/NY.GDP.MKTP.CD?locations=KR> (05.11.2018)
- Dünya Bankası, İstatistikler, <https://data.worldbank.org/indicator/NY.GDP.MKTP.CD?locations=TR> (05.11.2018)
- Erdoğan, S. ve Gürbüz, S. (2014). “Türkiye’de Enerji Tüketimi ve Ekonomik Büyüme İlişkisi: Yapısal Kırımlı Zaman Serisi Analizi”. *Selçuk Üniversitesi SBE Dergisi*, 32: 79-87.
- Ertuğrul, H. M. (2011). “Türkiye’de Elektrik Tüketimi Büyüme İlişkisi: Dinamik Analiz”. *Enerji, Piyasa ve Düzenleme*, 2: 49-73.
- Glasure, Y.U., ve Lee, A.R., (1997). “Cointegration, Error–Correction, and The Relationship Between GDP and Electricity: The Case of South Korea and Singapore”. *Resource and Electricity Economics* 20: 17–25.
- Ismiç, B. (2015). “Gelişmekte Olan Ülkelerde Elektrik Tüketimi, Ekonomik Büyüme Ve Nüfus İlişkisi”. *Çankırı Karatekin Üniversitesi İİBF Dergisi*, 5(1): 259-274.
- Mehrara, M. (2007). “Energy Consumption and Economic Growth: The Case of Oil Exporting Countries. *Energy Policy*, 35(5): 2939-2945.
- Oh, W., & Lee, K. (2004). Causal Relationship Between Energy Consumption and GDP Revisited: The Case of Korea 1970–1999. *Energy Economics*, 26(1): 51-59.
- Özata, E. (2010). “Türkiye’de Enerji Tüketimi ve Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişkilerin Ekonometrik İncelemesi”. *Dumlupınar Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi*, (26):101-113
- Payne, J. E. (2010). “A Survey of the Electricity Consumption-Growth Literature”. *Applied Energy*, 87(3): 723-731.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Pesaran, M. H., Shin, Y., ve Smith, R. J. (2001). "Bounds Testing Approaches to the Analysis of Level Relationships". *Journal of Applied Econometrics*, 16(3): 289-326.
- Polat, Ö., Uslu, E. E., ve San, S. (2011). "The Relationship among Electricity Consumption, Employment and Real Income in Turkey", *Suleyman Demirel University the Journal of Faculty of Economics and Administrative Sciences*, 16(1): 349-362.
- Saatçi, M., ve Dumrul, Y. (2013). "Elektrik Tüketimi ve Ekonomik Büyüme İlişkisinin Dinamik Bir Analizi: Türkiye Örneği". *Uludağ Üniversitesi İİBF Dergisi*, 32(2): 1-24.
- Savaş, B., ve Durğun, B. (2016). "Elektrik Tüketimi İle Ekonomik Büyüme Arasında Nedensellik İlişkisi: Türkiye Örneği". *Dicle Üniversitesi İİBF Dergisi*, 6(11): 213-244.
- Soytas, U., ve Sari, R. (2003). "Energy Consumption and GDP: Causality Relationship in G-7 Countries and Emerging Markets". *Energy Economics*, 25(1): 33-37.
- Uçak, S. ve Usupbeyli, A. (2015). "Türkiye'de Petrol Tüketimi ve Ekonomik Büyüme Arasındaki Nedensellik İlişkisi". *Ankara Üniversitesi SBF Dergisi*, 70(3): 769 - 787
- Yapraklı, S., ve Yurttançıkılmaz, Z. Ç. (2012). "Elektrik Tüketimi İle Ekonomik Büyüme Arasındaki Nedensellik: Türkiye Üzerine Ekonometrik Bir Analiz". *CÜ İİBF Dergisi*, 13(2): 195-215.

ICOAEF
Extended With
Social Sciences

POLİTİK İSTİKRAR VE BÜYÜME İLİŞKİSİ: NIC ÜLKELERİ ÖRNEĞİ

Selim DEMEZ*

Fatma Kızılkaya**

İdris Turan***

ÖZET

Politik istikrar ve ekonomik büyüme siyasi dalgalanmaların yoğun olarak yaşandığı ve demokratikleşme sürecini tamamlayamamış gelişmekte olan ülkeler için büyük öneme sahiptir. Bu çalışmada politik istikrar ile ekonomik büyüme arasındaki ilişki 2002-2017 döneminde Newly Industrialized Countries (NIC) ülkeleri için Konya (2006) bootstrap panel nedensellik analizi ile incelenmiştir. Analiz sonuçları Endonezya ve Türkiye’de ekonomik büyümeden politik istikrara tek yönlü nedensellik ilişkisi olduğunu göstermektedir.

***Anahtar kelimeler:** Ekonomik Büyüme, Politik İstikrar, Nedensellik Analizi*

***JEL Kodları:** F43, F50, C33*

THE RELATIONSHIP BETWEEN POLITICAL STABILITY AND GROWTH: THE CASE OF NIC COUNTRIES

ABSTRACT

Political stability and economic growth are of great importance for developing countries, where political fluctuations have been intense and have not completed the democratization process. In this study, the relationship between political stability and economic growth was investigated in the Newly Industrialized Countries (NIC) countries in the period of 2002-2017 by Konya (2006) bootstrap panel causality analysis. Analysis results indicate that unidirectional causality from economic growth to political stability in Indonesia and Turkey.

***Key words:** Growth, Political Stability, Causality Analysis*

***JEL Codes:** F43, F50, C33*

* Dr. Öğr. Üyesi, Hakkari Üniversitesi, Hakkari Üniversitesi İ.İ.B.F., Hakkari, Türkiye, selimdemez@hakkari.edu.tr

** Öğretim Görevlisi, Hakkari Üniversitesi, Hakkari Üniversitesi Yüksekova M.Y.O., Hakkari, Türkiye, fatmakizilkaya@hakkari.edu.tr

*** Arş. Gör., Sakarya Üniversitesi, Sakarya Üniversitesi S.B.F., Sakarya, Türkiye, turan.idris@gmail.com

1. GİRİŞ

Politik istikrar ya da istikrarsızlık ile ekonomik büyüme arasındaki ilişki ülkeler arasındaki büyüme ve gelir dağılımı gibi farklılıkları açıklamada kullanılan oldukça etkin bir değişken olarak karşımıza çıkmaktadır. Rostow (1990) politik istikrar ve güçlü bir rejimin, büyümenin ön koşulu olduğunu ve politik istikrarsızlığın tasarruflarda sürekli bir düşüşü beraberinde getirdiğini belirtmiştir (Baklouti ve Boujelbene, 2018: 249). Paolera ve Taylor (2003) politik istikrarın önemini Arjantin'in 1900 yıllarında gelişmiş bir ülke iken 2000 yılında gelişmekte olan ülke sınıfında yer almasının tamamen politik faktörlerden kaynaklandığını çalışmasından aktararak vurgulamaktadır (Campos ve Karanasos, 2008: 135). Literatürde politik istikrar ya da istikrarsızlığın birçok tanımı yer almaktadır. Lipset (1960) politik istikrarı tanımlarken yönetimin sürekliliğini vurgular. Lipset'in tanımında yönetim biçiminin diktatörlük ya da demokrasi olmasının hiçbir önemi yoktur. Her ne şekilde yönetilirse yönetilsin önemli olan hükümetin devamlılığıdır. Sanders (1981), Lipset'in tanımlamasındaki sürekliliğe ek olarak demokratik sistemin devamlılığında meşruluk ve etkinliğin önemine de dikkat çekmekte ve sık sık yaşanan hükümet değişiklikleri, askeri darbeler ve grevler gibi olaylar neticesinde meydana gelen hükümet değişikliklerinin istikrarsızlığı artırdığını belirtmektedir (Sanders, 1981: 51). Alesine and Perotti (1996) politik istikrarsızlığı anayasal ya da anayasal olmayan hükümet değişiminde beklenen eğilim, sosyal huzursuzluk ve politik şiddet olarak kategorize ederek tanımlamaktadır (Alesine and Perotti, 1996: 1206). Tüm bu tanımlamaların ışığında her ne sebeple olursa olsun iktidardaki mevcut hükümetin değişmesi politik istikrarsızlığın ana sebeplerinden biri olarak kabul edilmektedir.

Bu çalışmada politik istikrar ile ekonomik büyüme kavramsal olarak incelendikten sonra aralarındaki ilişki nedensellik analizi ile ampirik olarak incelenmiştir. Literatürde var olan çalışmalar politik istikrar ile büyüme arasında dolaylı ve doğrudan güçlü ve pozitif yönlü bir ilişki olduğunu ortaya koyarken (politik istikrarsızlık ile büyüme arasında bu ilişki negatif olmaktadır) ilişkinin yönü konusunda bir fikir birliği bulunmamaktadır.

2. LİTERATÜR

Literatürde politik istikrarsızlık ve ekonomik büyüme ile ilgili teorik ve ampirik birçok çalışma yer almakla birlikte genellikle politik istikrar ya da istikrarsızlığın ölçme biçimleri farklılık göstermektedir. Tablo 1'de konu ile ilgili yapılan çalışmaların özeti sunulmuştur.

Tablo 1. Literatür Özeti

| Yazar(lar) | Ülke (Grubu)- Dönem | Ekonometrik Yöntem | Sonuçlar |
|-------------------------------|---|--|---|
| Alesina vd. (1996) | 113 ülke 1950-1982 1960-1982 | Panel OLS | Üç farklı bağımlı değişken ile kurulan tüm modellerde politik istikrarsızlığı temsilen alınan değişkenlerin ekonomik büyümeyi azalttığını belirtmişlerdir. Ayrıca askeri darbeler söz konusu olduğunda mevcut hükümetin devrilme olasılığını artırdığı sonucuna varmışlardır. |
| Telatar (2003) | Türkiye 1986-2001 | Granger nedensellik analizi | Ekonomik büyümeden Politik istikrarsızlığı temsilen alınan faiz oranı farkı ve nominal döviz kuru artış oranına doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi bulunmuştur. |
| Pin (2009) | 119 ülke 1974- 2003 1984-2003 | Faktör analizi ve panel GMM | Politik istikrarsızlığın ekonomik büyüme üzerinde negatif etkisi olduğunu ortaya koymuştur. |
| Şanlısoy ve Kök (2010) | Türkiye 1987Q1- 2006Q4 | Gregory-Hansen eşbütünleşme analizi | Politik istikrarsızlık ile ekonomik büyüme arasında ters yönlü bir ilişki olduğunu ortaya koymuşlardır. |
| Demirgil (2011) | Türkiye 1970-2006 | GARCH ve EGARCH yöntemi | Türkiye için politik istikrarsızlık ve ekonomik büyüme arasında ters yönlü bir ilişki olduğu sonucuna varmıştır. |
| Arslan (2011) | Türkiye 1987-2007 | Johansen ve Juselius (1990) eşbütünleşme ve hata düzeltme modeli | Politik istikrarsızlık ve ekonomik büyüme arasında uzun dönemli bir ilişkinin olduğunu belirterek hata düzeltme modeline dayalı nedensellik analiz sonuçlarına göre ekonomik büyümeden politik istikrarsızlığa tek yönlü bir nedensellik ilişkisi olduğunu ortaya koymuştur. |
| Tang ve Abosedra (2014) | 24 MENA Ülkesi 2001-2009 | EKK ve GMM panel veri analizi | Enerji tüketimi ve turizm gelirlerinin ekonomik büyüme üzerinde önemli bir etkisi olduğunu belirtmişler ve politik istikrarsızlığın ise MENA ülkelerinin büyüme ve kalkınmasının önündeki en büyük engel olduğu sonucuna varmışlardır. |
| Parlakyıldız (2015) | Latin Amerika Ülkeleri 1999-2013 25 | Panel veri analizi | Politik istikrarsızlık endeksinin ekonomik büyüme üzerinde negatif etkiye sahip olduğunu belirtmiştir. |
| Tabassam vd. (2016) | Pakistan 1994-2016 | ARCH-GARCH | Politik istikrarsızlığın GDP üzerinde önemli düzeyde negatif bir etkiye sahip olduğunu belirtmişlerdir. |

| Yazar(lar) | Ülke (Grubu)- Dönem | Ekonometrik Yöntem | Sonuçlar |
|---------------------------------|--------------------------------------|---|--|
| Yalçınkaya ve Kaya (2017) | G-8 ve G-12 Ülkeleri 1996-2015 | Panel Kao eşbütünleşme, Fisher panel nedensellik analizleri | G12 ve G-8 ülkelerinin uzun dönemde büyüme rakamları üzerinde farklılık yaratan unsurun politik istikrar olduğunu belirterek, politik istikrarsızlığın büyüme üzerinde G-12 ülkelerinde pozitif G-8 ülkelerinde negatif etkisi olduğu sonucuna varmışlardır. |
| Kartal ve Öztürk (2017) | Türkiye 1955- 2015 | Temel Bileşenler Analizi | Türkiye’de politik istikrarsızlığın yoğun olduğu dönemlerde ekonomik büyümeyenin negatif etkilendiğini belirtmişlerdir. |
| Al ve Belke (2018) | 14 MENA Ülkeleri 1991-2016 | Konya (2006) Panel nedensellik analizi | İran ve İsrail dışındaki ülkelerde modeldeki değişkenlerden büyümeye çift ve tek yönlü nedensellik ilişkileri bulunmuştur. |

3. EKONOMETRİK YÖNTEM VE BULGULAR

Bu çalışmada, 2002-2017 dönemi verileri kullanılarak, Yeni Sanayileşmiş Ülkelerde (NIC: Brezilya, Çin, Endonezya, Hindistan, Meksika, Malezya, Filipinler, Tayland, Türkiye ve Güney Afrika) politik istikrar ve büyüme ilişkisi incelenmiştir. Çalışmada Dünya Bankasının yayınladığı Dünya Yönetişim Göstergelerinin altı endeksinden birisi olan Politik İstikrar ve Şiddet/Terör Olmaması endeksi ve reel GSYİH verileri kullanılmıştır. Çalışmada değişkenler arasındaki nedensellik ilişkisi Konya (2006) tarafından geliştirilen bootstrap panel nedensellik testi ile incelenmiştir. Analizde kullanılan veriler Dünya Bankası veri dağıtım sistemi (<http://data.worldbank.org>) web sayfasından elde edilmiştir. Reel GSYİH serisi logaritmik dönüşüm yapıldıktan sonra analize dâhil edilmiştir.

Panel veride değişkenler arasında nedensellik ilişkisini test etmek için öncelikle panel üyeleri arasında olası bir yatay kesit bağımlılığını ve eğim heterojenliğini araştırmak gerekmektedir. Yatay kesit bağımlılığı ve homojenlik testi sonuçları Tablo 2’de verilmiştir.

Tablo 2. Yatay Kesit Bağımlılığı ve Heterojenlik Testi Sonuçları

| Yöntem | Test İstatistiği | p-değeri |
|--|------------------|----------|
| <i>Yatay Kesit Bağımlılığı Testi</i> | | |
| <i>CD_{BP} (Breusch -Pagan 1980)</i> | 718.30* | 0.000 |
| <i>Pesaran CD (Pesaran 2004)</i> | 26.80* | 0.000 |
| <i>LM_{adj} (Pesaran vd. 2008)</i> | 25.47* | 0.000 |
| <i>Homojenlik Testi</i> | | |
| <i>Swamy</i> | 10.14** | 0.038 |
| $\hat{\Delta}$ | 8.46* | 0.000 |
| $\hat{\Delta}_{adj}$ | 9.32* | 0.000 |

Not: *, ** ve *** sırasıyla; %1, %5 ve %10 düzeyinde anlamlılığı göstermektedir.

Tablo 2 incelendiğinde, kullanılan her üç test (CD_{BP} , Pesaran CD ve LM_{adj}) içinde yatay kesit bağımlılığının olmadığını ifade eden sıfır hipotezi reddedilmiş ve yatay kesit bağımlılığını olduğuna karar verilmiştir. Yine Tablo 2'den her üç test (Swamy, $\hat{\Delta}$ ve $\hat{\Delta}_{adj}$) içinde homojenliği gösteren sıfır hipotezi reddedilmiş ve eğim katsayılarının heterojen olduğu sonucuna ulaşılmıştır.

3.1. Bootstrap Panel Nedensellik Testi

Konya (2006) tarafından geliştirilen panel bootstrap nedensellik testi Görünürde İlişkisiz Regresyon (SUR) modellerine ve ülkeye özgü bootstrap kritik değerlere sahip Wald testine dayanmaktadır. Panel bootstrap nedensellik testi için kullanılacak denklem kümesi şu şekildedir;

$$\begin{aligned}
 Y_{1,t} &= \alpha_{1,1} + \sum_{l=1}^{mly_1} \beta_{1,1,l} Y_{1,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_1} \delta_{1,1,l} X_{1,t-l} + \varepsilon_{1,1,t} \\
 Y_{2,t} &= \alpha_{1,2} + \sum_{l=1}^{mly_1} \beta_{1,2,l} Y_{2,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_1} \delta_{1,2,l} X_{2,t-l} + \varepsilon_{1,2,t}
 \end{aligned} \tag{1}$$

$$\begin{aligned}
 Y_{N,t} &= \alpha_{1,N} + \sum_{l=1}^{mly_1} \beta_{1,N,l} Y_{N,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_1} \delta_{1,N,l} X_{N,t-l} + \varepsilon_{1,N,t} \\
 X_{1,t} &= \alpha_{2,1} + \sum_{l=1}^{mly_2} \beta_{2,1,l} Y_{1,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_2} \delta_{2,1,l} X_{1,t-l} + \varepsilon_{2,1,t} \\
 X_{2,t} &= \alpha_{2,2} + \sum_{l=1}^{mly_2} \beta_{2,2,l} Y_{2,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_2} \delta_{2,2,l} X_{2,t-l} + \varepsilon_{2,2,t}
 \end{aligned} \tag{2}$$

$$X_{N,t} = \alpha_{2,N} + \sum_{l=1}^{mly_2} \beta_{2,N,l} Y_{N,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_2} \delta_{2,N,l} X_{N,t-l} + \varepsilon_{2,N,t}$$

Burada N panelin ülke sayısını ($i=1, \dots, N$), t zaman boyutunu ($t=1, \dots, T$), l ise gecikme uzunluğunu ifade etmektedir. Bu sistemdeki Granger nedenselliğini test etmek için, ülke j için alternatif nedensellik ilişkilerin bulunması muhtemeldir: Örneğin Denklem (1) ve (2) incelendiğinde eğer bütün $\delta_{1,j,l}$ 'ler sıfır değil fakat bütün $\beta_{2,j,l}$ 'ler sıfır ise X'ten Y'ye tek yönlü Granger nedensellik vardır. Panel bootstrap nedensellik testi sonuçları Tablo 3'de sunulmuştur.

Tablo 3. Bootstrap Panel Nedensellik Testi Sonuçları

| Ülkeler | H_0 : Politik istikrar, büyümenin nedeni değildir. | | H_0 : Büyüme, politik istikrarın nedeni değildir. | |
|--------------|--|----------|---|----------|
| | Wald İstatistiği | p-değeri | Wald İstatistiği | p-değeri |
| Brezilya | 0.069 | 0.925 | 0.006 | 0.957 |
| Çin | 29.928 | 0.304 | 0.971 | 0.552 |
| Endonezya | 3.570 | 0.553 | 94.456*** | 0.062 |
| Hindistan | 0.024 | 0.945 | 0.456 | 0.525 |
| Meksika | 0.142 | 0.889 | 0.007 | 0.977 |
| Malezya | 0.376 | 0.901 | 1.879 | 0.456 |
| Filipinler | 4.672 | 0.413 | 3.547 | 0.125 |
| Tayland | 3.077 | 0.350 | 0.751 | 0.458 |
| Türkiye | 4.807 | 0.316 | 33.086*** | 0.074 |
| Güney Afrika | 16.309 | 0.555 | 1.014 | 0.387 |

Not: *, ** ve *** sırasıyla; %1, %5 ve %10 düzeyinde anlamlılığı göstermektedir. Bootstrap kritik değerleri 10.000 döngüyle elde edilmiştir.

Tablo 3 ile verilen Wald istatistikleri incelendiğinde büyümenin, politik istikrarın nedeni olmadığını ifade eden sıfır hipotezi Endonezya ve Türkiye için reddedilmektedir. Yani Endonezya ve Türkiye için büyüme politik istikrarın nedenidir. Politik istikrarın, büyümenin nedeni olmadığını ifade eden sıfır hipotezi ise bütün NIC ülkeleri için reddedilememektedir. Yani NIC ülkeleri için politik istikrar büyümenin nedeni değildir. Bulunan bu nedensellik ilişkilerinin düşük ekonomik büyüme oranının, politik istikrarsızlığın önemli göstergelerinden olan, iktidardaki hükümetin değişme ve toplumsal olaylar, şiddet, terör ve darbe olasılıklarını artırmasından kaynaklandığı düşünülmektedir (Allesina vd., 1996: 191).

4. SONUÇ

Politik istikrar/istikrarsızlık ekonomik büyüme ilişkisi özellikle içsel büyüme teorilerinin ortaya çıkması ile birlikte literatürde farklı boyutlarda oldukça fazla çalışma alanı bulmuş bir konudur. Genel olarak teorik ve ampirik literatür politik istikrar/istikrarsızlık ekonomik büyüme arasında doğrudan ve dolaylı olarak güçlü bir ilişkinin olduğudur. İlişkinin yönü ampirik sonuçlara göre değerlendirilmekte ve farklılık göstermektedir.

Bu çalışmada, NIC ülkeleri için politik istikrar ve büyüme arasındaki nedensellik ilişkisi Konya (2006) tarafından geliştirilen bootstrap panel nedensellik testi ile analiz edilmiştir. Elde edilen sonuçlar Endonezya ve Türkiye için büyümeden politik istikrara doğru nedensellik ilişkisinin olduğunu göstermektedir. Ayrıca NIC ülkelerinin hiçbirinde politik istikrardan büyümeye doğru nedensellik ilişkisi elde edilememiştir. Türkiye için ekonomik büyümeden politik istikrara doğru bulunan nedensellik ilişkisi Aslan (2011) ve Telatar (2003)'ün yaptığı çalışmalardan elde ettiği bulguları desteklemektedir.

KAYNAKÇA

- Al, İ., & Belke M. (2018) "Politik İstikrarsızlık İle Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişki: Mena Ülkeleri İçin Panel Nedensellik Analizi", UIİİD-IJEAS, (Prof. Dr. Harun Terzi Özel Sayısı): 271-286 ISSN 1307-9832.
- Alesina, A., ve Perotti, R. (1996) "Income distribution, political instability, and investment", *European Economic Review*, 40(6): 1203-1228.
- Alesina, A., Özler, S., Roubini, N., ve Swagel, P. (1996) "Political Instability And Economic Growth", *Journal Of Economic Growth*, 1(2): 189-211.
- Arslan, Ü. (2011) "Siyasi İstikrarsızlık Ve Ekonomik Performans: Türkiye Örneği", *Ege Akademik Bakış*, 11(1): 73-80.
- Baklouti, N., ve Boujelbene, Y. (2018) "The Nexus Between Democracy And Economic Growth: Evidence From Dynamic Simultaneous-Equations Models", *Journal of the Knowledge Economy*, 9(3): 980-998.
- Breusch, T. S., ve Pagan, A. R. (1980) "The Lagrange Multiplier Test and Its Applications to Model Specification in Econometrics", *The Review of Economic Studies*, 47(1): 239-253.
- Campos, N. F., ve Karanasos, M. G. (2008) "Growth, Volatility And Political Instability: Non-Linear Time-Series Evidence For Argentina, 1896–2000", *Economics Letters*, 100(1): 135-137.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Demirgil, H. (2011) "Politik İstikrarsızlık, Belirsizlik Ve Makroekonomi: Türkiye Örneği (1970-2006)", Marmara University Journal of the Faculty of Economic & Administrative Sciences, 31(2).
- Kalay, M., ve Çetin, D. (2016) "Afrika Ülkelerinde Politik İstikrar ve Ekonomik Büyüme", Itobiad: Journal of the Human & Social Science Researches, 5(7).
- Kartal, G., ve Öztürk, S. (2017) "Türkiye'de Politik İstikrarsızlık Ve Ekonomik Büyüme İlişkisi", Ömer Halisdemir Üniversitesi İktisadi Ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 10(4): 250-270.
- Kónya, L. (2006) "Exports and Growth: Granger Causality Analysis On OECD Countries With A Panel Data Approach", Economic Modelling, 23(6): 978-992.
- Lipset, S. M. (1960) "The Social Bases Of Politics", Baltimore: The Johns Hopkins University Press.
- Parlakıyıldız, F. M. (2015) "Makro Ekonomik Ve Politik İstikrarsızlığın Ekonomik Performans Üzerine Etkisi: Latin Amerika Örneği", Çukurova Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 19(2): 1-11.
- Pesaran, M. H. (2004) "General Diagnostic Tests for Cross Section Dependence in Panels", Journal of Econometrics, 142: 50-93.
- Pesaran, M. H. (2006) "Estimation and Inference in Large Heterogeneous Panels with A Multifactor Error Structure", Econometrica, 74(4): 967-1012.
- Pesaran, M. H., ve Yamagata, T. (2008) "Testing Slope Homogeneity in Large Panels", Journal of Econometrics, 142(1): 50-93.
- Pesaran, M. H., Ullah, A., ve Yamagata, T. (2008). "A Bias-Adjusted Lm Test of Error Cross-Section Independence", The Econometrics Journal, 11(1): 105-127.
- Sanders, D. (1981) "Patterns Of Political Instability", Macmillan.
- Şanlısoy, S., ve Kök, R. (2010) "Politik İstikrarsızlık-Ekonomik Büyüme İlişkisi: Türkiye Örneği (1987-2006)", Dokuz Eylül Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 25(1): 101-125.
- Swamy, P. A. (1970) "Efficient Inference In A Random Coefficient Regression Model", Econometrica: Journal of the Econometric Society, 311-323.
- Tabassam, A. H., Hashmi, S. H., ve Rehman, F. U. (2016) "Nexus Between Political Instability And Economic Growth In Pakistan", Procedia-Social and Behavioral Sciences, 230: 325-334.
- Tang, C. F., ve Abosedra, S. (2014) "The Impacts Of Tourism, Energy Consumption And Political Instability On Economic Growth In The Mena Countries", Energy Policy, 68: 458-464.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Telatar, F. E. (2003) “Türkiye’de Politika Değişkenliği İle Ekonomik Büyüme Arasındaki Nedensellik İlişkileri 1986-2001”, İktisat İşletme ve Finans, 18(211): 71-91.

Yalçınkaya, Ö., ve Kaya, V. (2017) “Politik İstikrarın/İstikrarsızlığın Ekonomik Büyüme Üzerindeki Etkileri: Dünyanın En Büyük İlk Yirmi Ekonomisi Üzerinde Bir Uygulama (1996-2015)”, Uluslararası Yönetim İktisat ve İşletme Dergisi, 13(2): 277-298.



**DÖNÜŞTÜRÜCÜ LİDERLİK VE İNOVASYON KÜLTÜRÜ İLİŞKİSİ ÜZERİNE BİR
ARAŞTIRMA¹**

Semra TETİK*

Bilgehan EMEKLİER**

Nihal EMEKLİER***

ÖZET

Günümüzde her alanda baş döndürücü bir hızla değişim yaşanmaktadır. İşletmelerin ayakta kalabilmesi ve rekabette öne çıkabilmesi için değişimi etkili bir şekilde yönetebilmeleri ve inovasyona odaklanmaları gerekmektedir. Bu da dönüştürücü liderlik anlayışını ve işletmede inovasyon kültürünün oluşturulmasını ve yaygınlaştırılmasını gerekli kılmaktadır. Bu çalışmanın amacı, dönüştürücü liderlik ile inovasyon kültürü arasındaki ilişkiyi incelemektir. Bu amaçla Manisa Organize Sanayi Bölgesi'nde faaliyette bulunan büyük ölçekli işletmelerde anket uygulaması gerçekleştirilmiştir. Analiz sonuçlarına göre dönüştürücü liderlik ile inovasyon kültürü arasında pozitif yönde orta düzeyde anlamlı bir ilişki tespit edilmiştir.

Anahtar Kelimeler: Dönüştürücü Liderlik, İnovasyon, İnovasyon Kültürü

Jel Kodları: M10, M12, M14,

**A RESEARCH ON THE RELATIONSHIP BETWEEN TRANSFORMATIONAL
LEADERSHIP AND INNOVATION CULTURE**

ABSTRACT

Nowadays, significant changes are occurring in every area at an unprecedented pace. Enterprises should be able to manage these changes effectively and focus on innovation in order to survive and stand out in the competition. This necessitates transformative leadership and the creation and dissemination of innovation culture in the enterprise. Transformative leadership approach holds an essential place in all public and private enterprises. The aim of this study is to examine the relationship between transformative leadership and innovation culture. From this point of view, questionnaires were applied and analyzed in large scale enterprises operating in Manisa Organized Industrial Zone.

¹ Bu çalışma Manisa Celal Bayar Üniversitesi Bilimsel Araştırma Projeleri Koordinasyon Birimi tarafından desteklenmektedir.

* Dr.Öğr.Üyesi, Manisa Celal Bayar Üniversitesi, Salihli Meslek Yüksekokulu, semratetik@hotmail.com

** Öğr.Gör., Manisa Celal Bayar Üniversitesi, Salihli Meslek Yüksekokulu, bilgehanemeklier@yahoo.com

*** Doktora Öğrencisi, Galatasaray Üniversitesi, nihalgul@yahoo.fr

According to the analysis results, it was found a positive relationship between transformational leadership and innovation culture.

Keywords: *Transformational Leadership, Innovation, Innovation Culture*

Jel Codes: *M10, M12, M14*

1. GİRİŞ

Küresel rekabetin artmasıyla birlikte, tüketicilerin daha fazla yenilik talep etmesi, ürün yaşam sürelerinin kısalması, rakiplerin yenilikleri hızla takip eder hale gelmesi işletmeleri yok olma tehlikesiyle karşı karşıya bırakmaktadır. Bunun yanı sıra sürekli gelişen iletişim teknolojileri sayesinde e-ticaretin giderek yaygınlaşması, yeni iş modellerinin ortaya çıkması işletmelerin varlığını sürdürmesi ve rekabette üstünlük sağlaması için inovasyona odaklanmasını gerektirmektedir. Küreselleşmenin yol açtığı bu gelişmeler işletmelerin yönetim anlayışını da değiştirmiş ve dönüştürücü liderlik tarzı öne çıkmıştır. Dönüştürücü liderler, değişime uyum sağlamanın ötesinde proaktif bir yaklaşımla değişimi ve dönüşümü başlatan kişilerdir. İşletmelerde inovasyon kültürü oluşturarak inovasyon uygulamalarını sürekli hale getirebilecek en etkili liderlik tarzı dönüştürücü liderliktir.

Dönüştürücü liderler astların gereksinimlerini, inançlarını, değer yargılarını değiştiren ve işletmeyi değişim ve inovasyonu gerçekleştirerek üstün performansa ulaştıran kişilerdir (Koçel, 1998:413). Tichy ve Devanna (1986) tarafından dönüştürücü liderlerin sahip olduğu özellikler şu şekilde ifade edilmiştir: Dönüştürücü liderler değişim temsilcisi, yürekli ve cesaretli, insanlara güvenen, örgütsel değerleri önemseyen, yaşam boyu öğrenmeye açık, belirsizliğe karşı toleranslı ve ileri görüşlü kişilerdir (Keçecioğlu, 2003:37).

Dönüştürücü liderler astlarının kendilerini geliştirmesi için onları motive eden, astlarını sürekli güçlendiren, bakış açılarını değiştirerek sorunlarına inovatif yöntemlerle yaklaşmasını sağlayan ve grup hedeflerine ulaşma konusunda çalışanlarını başarılı bir şekilde motive eden kişilerdir (Robbins ve Judge, 2011: 392; Ünder, 2017: 22). Dönüştürücü liderlik geleceğe, yeniliğe, değişime ve reforma dönük bir liderlik tarzıdır. Bundan dolayı da yeni bir vizyon yaratmayı ve bu vizyonu birlikte çalıştığı astlarla paylaşmayı gerekli kılar (Çelik ve Eryılmaz, 2006: 212). Dolayısıyla dönüştürücü liderler, yaratıcı sürecin temel yönlendiricisi olan değişimi ve dönüşümü sağlayarak inovasyon ortaya koyarlar (Oke vd., 2009:68; Karcıoğlu ve Kaygın, 2013:5).

Inovasyon, ilk kez ekonomist Joseph A. Schumpeter tarafından “kalkınmanın itici gücü” şeklinde tanımlanmıştır. Schumpeter, inovasyonu, “henüz var olmayan bir ürünün veya mevcut bir ürünün yeni bir niteliğinin pazara sürülmesi; yeni bir üretim metodunun geliştirilmesi; yeni bir pazarın oluşturulması; yeni bir hammadde kaynağının bulunması; endüstride yeni organizasyon yapıları geliştirme” olarak tanımlamıştır (Atik, 2005; İyigün, 2015:1). Porter (1990)’e göre inovasyon, rekabet

avantajı sağlayan hem yeni teknolojileri hem de yeni iş yapma yöntemlerini kapsamaktadır. “Bir ülkede refah düzeyi ve yaşam standartları, rekabet gücünün artmasına bağlı olarak iyileşme göstermektedir. Rekabet gücünün artması da üretkenliğin artışı ile mümkün olmaktadır. Üretkenliği artıran en önemli araç inovasyondur. Bu nedenle inovasyon, ülkeler için ekonomik büyümenin, artan istihdamın ve yaşam kalitesinin anahtarıdır. Bu tanımda inovasyonun beş temel fonksiyonu vurgulanmıştır (Vyas, 2009:9; Vayni, 2017:36):

- 1) Yeni ürünlerin yaratımı veya mevcut ürünlerde niteliksel gelişim
- 2) Yeni bir sanayi sürecinin kullanımı
- 3) Yeni pazarlara açılım
- 4) Yeni hammadde kaynakları veya diğer yeni girdilerin gelişimi
- 5) Sanayii örgütlerinin yeni biçimleri

Oslo Kılavuzu (2005)'na göre inovasyon “işletme içi uygulamalarda, işyeri organizasyonunda veya dış ilişkilerde yeni veya önemli derecede iyileştirilmiş bir ürün (mal veya hizmet), veya süreç, yeni bir pazarlama yöntemi ya da yeni bir organizasyon yapısının gerçekleştirilmesidir” (Gökçe, 2010:1). İnovasyon işletmeler için yaşamını sürekli kılma ve sağlıklı büyümenin ön koşuludur. Sağlıklı bir uygulama için dönüştürücü liderlerin işletmelerin özelliğine, yapısına ve amaçlarına uygun güçlü bir inovasyon kültürü oluşturmaları ve yaygınlaştırmaları gerekmektedir.

Gandotra (2010:56)'ya göre İnovasyon kültürü, inovasyonu işletmenin günlük yaşamı haline getiren kültürdür. İnovasyon kültürü, örgütünün günlük rutin işlerini yaparken, yeni ürünler, süreçler ve düzenlemeler tanımlamak, yürürlüğe koymak ve geliştirmek için örgütsel bir yetenektir (Losane, 2013:2757). İnovasyon kültürü, liderlerin alışılmadık dışındaki düşünce ve uygulamaları sağlamak için oluşturdukları çalışma ortamıdır. İnovasyon kültürünün oluşturulması işletme yöneticisinin, yani liderin, sorumluluğundadır. Kültürel değişim, inançların, değerlerin, tutumların ve davranışların değişimiyle ilgilidir. Öncelikle insanların kafa yapılarının değişmesini gerektirir. Bu, kolay bir değişim değildir ve belli bir süre gerektirir. Bu sürenin uzunluğu veya kısalığı, liderin inovasyon konusunu sahiplenme düzeyi ve bu amaçla gerekli farkındalığı ve motive edici ortamı yaratmasıyla bağlantılıdır. Eğer bir örgüt güçlü bir inovasyon kültürüne sahipse, örgütün yeni fikirleri deneme, risk alma ve inovasyonu teşvik etme olasılığı yüksektir (O'Reilly et al., 1991). Bu ortamı da en iyi şekilde, yenilikçi bir özelliğe sahip olmalarından dolayı dönüştürücü liderler oluşturabilirler.

Dönüştürücü liderlikle ilgili literatürde birçok özelliğin atfedildiği görülmektedir. Dönüştürücü liderliğin başat özellikleri aşağıda açıklanmıştır.

Vizyon belirleme ve yön çizme yeteneği; vizyon belirleyebilme, bir yöneticinin lider kimliğine bürünebilmesinin somut koşudur. Bir liderin geleceği görebilmesi, bugünkü eğilimlerden geleceğin ne

şekilde oluşacağını önceden görebilmesi, bulunduğu örgüte, ülkeye, dünyaya yeni eğilimler sunması ve bunu kabul ettirmesi vizyon olarak belirlenebilir (Synder ve Graves, 1994:1; Gündüz, 1998:75).

Destekleyici örgüt kültürünü geliştirme; örgüt kültürü, kişinin örgütte kendini anlamlandırmasına fırsat veren ve onun inanış, düşünüş ve davranış biçimini belirleyen normlar ve değerler bütünüdür (Yılmaz ve Eroğlu, 2013:113). Dönüştürücü liderlerin güçlü bir örgüt kültürü oluşturmaları ve yaygınlaştırmaları izleyenlerde biz duygusunun oluşturulması açısından önemlidir. Güçlü bir örgüt kültürü çalışanlara örgütte hangi değerlerin önemli olduğu, iletişim biçimleri, yönetim tarzı, nelerin yapıp yapılmayacağı konusunda yol gösterir.

Derinliğine bilgili olmak ve politik kişilik; dönüştürücü lider olmak, birkaç konuda derinliğine bilgili olmayı gerektiren, birçok konuda da bilgili olmayı, sağlam bir kişiliğe sahip olmayı gerektirir (Buzan ve Keane, 1966:7; Gündüz, 1998:76). Dönüştürücü lider, sürekli öğrenmeyi bir yaşam felsefesi haline getirerek ve yönetim biliminde meydana gelen değişiklikleri takip ederek kendisini sürekli yeniler.

Yetki ve sorumluluk devretmek; yetki yasal güce sahip olma ve bunu kullanmadır (Koçel, 2005:214). Yetki devri, belirli görevlerin yerine getirilmesi için yetkinin bir yönetici ya da örgüt biriminden diğerine aktarılması olarak ifade edilebilir. Yöneticiler astlarına yetki devrederler, ancak sorumluluktan kurtulamazlar. Sorumluluğun kaynağı sahip olunan iş yapma ve yaptırma yetkisidir (Güney, 2000:227). Örgütlerin tepe yöneticileri lider niteliklerine sahip yönetici olmalı ve örgütlerini dönüştürmelidir.

Yaratıcılık; dönüştürücü liderde bulunması gereken önemli özelliklerden birisi de yaratıcılıktır (Eraslan, 2004:14). Yaratıcılığın en önemli kriteri özgünlüktür. Özgünlük, problemlere yeni çözüm yolları bulmak ya da inovatif süreçlerin ve ürünlerin oluşturulması olarak ifade edilebilir (Averill, 1999:333; Aydın ve Çakar, 2014:82). Çağımızda örgütlerin gelişmesi en çok yaratıcı nitelikteki liderlerin varlığı ile sağlanabilmektedir. Dönüştürücü liderler zeki, yaratıcı ve yenilikçidir (Tekin, 2014:210).

Sorun çözme yeteneği; bir insanın, örgütün ve hatta ülkenin güçlü olabilmesinin temel göstergesi sorun çözme yeteneğidir. Öyleyse bu, dönüştürücü lider için de geçerlidir (Gündüz, 1998:77). Yönetici bir taraftan sorun çıkmasına engel olmaya çalışırken, diğer taraftan da ortaya çıkan sorunları çözmeye çalışır (Özalp vd., 1996:15). Yöneticinin lider olarak farklı olabilmesi, yer aldığı örgütte liderliğini gösterebilmesi, kronik hale gelmiş sorunlara çözüm üreteceği görüşlere ve uygulamalara bağlıdır (Gündüz, 1998:77).

Duygusal dayanıklılık, cesaret, risk alma; Zel (1997:67) dönüştürücü lider, olayları bireysel olarak düşünmeyen, eleştiriler karşısında yılmayan, duygularını doğru yöneten ve başarısız olmaktan korkmayan bir kişiliğe sahiptir. Duygusal dayanıklılık aynı zamanda kendi içindeki çatışmayı da engellediğinden dolayı kendine güven, kararlılık, inanç ve stres ortamlarına dayanıklılığı artırır. Menguc ve arkadaşları (2007), dönüştürücü liderliğin şimdiki ve gelecekteki problemleri çözmeye, risk almada

ve görevleri yapmanın uygun yollarını bulma zorluğunda yenilikçi düşünce için izleyenleri daha fazla cesaretlendirmeyi içerdiğini ifade etmişlerdir (Karcıoğlu ve Kaygın, 2013:107).

Pozitif bakış açısı; Özkara (1999:47)'ya göre psikolojik kişilik açısından kişiler; negatif kişilik, nötrale kişilik ve pozitif kişilik olmak üzere üç gruba ayrılır. Dönüştürücü liderler pozitif bakış açısına sahip olmalıdır. Pozitif düşünce; umut, iyimserlik, öz-yeterlik ve dayanıklılık unsurlarını içermekte olup bireylerin pozitif güçlerine odaklanan bir bakış açısıdır (Luthans, vd., 2010:42). Pozitif bakış açısına sahip lider, izleyenlerin zayıf yönlerinden ziyade, onların güçlü yönleri ve erdemlerine odaklanır (Seligman, 1998; Çetin vd., 2013:34).

Etkili iletişim becerisi; iletişim ve motivasyon çalışanların verimliliğini ve yaratıcılığını artırmada en etkili rolü oynamaktadır. Bir liderin sahip olması gereken temel özelliklerden biriside iletişim becerisidir. Etkili iletişim becerisi, liderin izleyenlerini anlamada, onların duygu ve düşüncelerini onlarla özdeşleşerek görme duyarlılığı kazanmasında oldukça önemlidir (Çetinkaya ve Alparslan, 2011:368).

Bu çalışma, büyük ölçekli işletmelerin üst, orta ve alt düzey yöneticilerinin algılarına göre dönüştürücü liderlik ve inovasyon kültürü arasındaki ilişkiyi incelemek amacıyla taşımaktadır.

2. METODOLOJİ

Araştırmada anket yöntemi kullanılmıştır. Anket formu üç bölümden oluşmaktadır. Birinci bölümde yöneticilerin demografik özelliklerini tespit etmeye yönelik sorular bulunmaktadır. İkinci bölümde dönüştürücü liderlik için Podsakoff vd.(1996)'nin geliştirdiği ve İşcan (2002) tarafından Türkçeye uyarlanan "Dönüştürücü Liderlik" ölçeği ve inovasyon kültürü için Arthur D. Little tarafından geliştirilen "Innovation Management Health Check" isimli ölçek yer almaktadır. Soruları yanıtlamada 5'li Likert yönteminden (1=hiç katılmıyorum; 5=tamamen katılıyorum) yararlanılmıştır. Ölçeklerin Cronbach Alfa katsayıları dönüştürücü liderlik ölçeği için .87, inovasyon kültürü için .92 olarak bulunmuştur.

2.1 Araştırmanın Amacı ve Önemi

Bu araştırmada, dönüştürücü liderlik ve inovasyon kültürü arasındaki ilişkiyi incelemek amaçlanmıştır. Dönüştürücü liderlik davranışı; vizyon ilham sağlama ve rol modeli olma, entelektüel teşvikte bulunma, grup amaçlarının kabulünü sağlama, izleyenlerine bireysel ilgi gösterme ve yüksek başarı beklentisi boyutlarıyla, inovasyon kültürü ise tek boyut olarak incelenmiştir. Literatürde dönüştürücü liderlik ile inovasyon kültürü ilişkisini büyük ölçekli işletmeler özelinde inceleyen bir çalışmaya rastlanmamıştır. Bu yönüyle çalışmanın literatüre katkı sağlayacağı düşünülmektedir.

2.2. Evren ve Örneklem

Araştırmanın evrenini Manisa Organize Sanayi Bölgesi'nde faaliyet gösteren Türkiye'nin ilk 500 sanayi kuruluşu arasında yer alan 17 firma oluşturmaktadır. Evrenin tümüne ulaşılmaya çalışılmıştır, ancak 13 firma anket uygulanmasına izin vermiştir. Bu da evrenin %77'sini temsil etmektedir. Ulaşılabilen 13 firmadan anketlere yanıt veren 130 yönetici araştırmanın örneklemine oluşturmaktadır.

2.3. Araştırmanın Hipotezleri

Dönüştürücü liderlik ve inovasyon kültürü arasındaki ilişkiyi araştıran bu çalışmada aşağıdaki hipotez ve alt hipotezler oluşturulmuştur.

H1: Dönüştürücü liderlik ile inovasyon kültürü arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H1a: Vizyon, ilham ve rol modeli olma özelliği ile inovasyon kültürü arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H1b: Entelektüel teşvik özelliği ile inovasyon kültürü arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H1c: Grup amaçlarının kabulünü sağlama özelliği ile inovasyon kültürü arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H1d: Bireysel ilgi özelliği ile inovasyon kültürü arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H1e: Yüksek başarı beklentisi özelliği ile inovasyon kültürü arasında anlamlı bir ilişki vardır.

Araştırma probleminin çözümlenmesinde geliştirilen hipotezler korelasyon analizi ile test edilmiştir.

3. BULGULAR

Bu bölümde araştırmaya katılan yöneticilerin demografik özelliklerine ilişkin bulgulara ve dönüştürücü liderlik ve inovasyon kültürü arasındaki korelasyon analizine ilişkin bulgulara verilmiştir.

3.1. Örneklem Demografik Özelliklere İlişkin Bulgular

Örneklem %14,6'sını (19 kişi) kadınlar, %85'ini (111 kişi) erkekler oluşturmaktadır. Örneklem %3,8'i (5 kişi) 30'dan küçük, %53,1'i (69 kişi) 31-40 yaş aralığında, %36,9'u (48 kişi) 41-51 yaş aralığında, %6,2'si ise (8 kişi) 50'den büyüktür. Örneklem eğitim durumlarına göre dağılımlarına bakıldığında %4,6'sı (6 kişi) lise mezunu, %6,2'si (8 kişi) önlisans mezunu, %70,8'i (92 kişi) lisans mezunu ve %18,5'i (24 kişi) lisansüstü mezundur. İşletmede çalışma sürelerine göre örneklem %12,3'ü (16 kişi) 1-5 yıl, %36,2'si (47 kişi) 6-10 yıl, %24,6'sı (32 kişi) 11-15 yıl ve %26,9'u (35 kişi) 16 yıldan fazla süredir çalışmaktadır. İşletmedeki pozisyonlarına göre örneklem %11,5'i (15 kişi) üst düzey yönetici, %46,9'u (61 kişi) orta düzey yönetici, %41,5'i (54 kişi) alt düzey yöneticidir.

3.2. Korelasyon Analizine İlişkin Bulgular

Dönüştürücü liderlik ve alt boyutları ile inovasyon kültürü arasındaki ilişki ve dönüştürücü liderlik boyutlarının kendi arasındaki ilişki korelasyon analizi ile test edilmiş ve aralarındaki ilişkilerin anlamlı olup olmadığı tespit edilmeye çalışılmıştır.

Tablo 1. Dönüştürücü Liderlik ve İnovasyon Kültürü Arasındaki Korelasyon Analizi Sonuçları

| BOYUTLAR | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
|--------------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---|
| 1. Vizyon İlham Rol Modeli | 1 | | | | | | |
| 2. Grup Amaçlarının Kabulünü Sağlama | ,735** ,000 | 1 | | | | | |
| 3. Entelektüel Teşvik | ,628** ,000 | ,652** ,000 | 1 | | | | |
| 4. Bireysel İlgî | ,405** ,000 | ,444** ,000 | ,438** ,000 | 1 | | | |
| 5. Yüksek Başarı | ,425** ,000 | ,330** ,000 | ,445** ,000 | ,202* ,021 | 1 | | |
| 6. Dönüştürücü Liderlik | ,822** ,000 | ,804** ,000 | ,820** ,000 | ,664** ,000 | ,675** ,000 | 1 | |
| 7. İnovasyon Kültürü | ,562** ,000 | ,333** ,000 | ,406** ,000 | ,387** ,000 | ,202* ,021 | ,491** ,000 | 1 |

Tablo 1’de yer alan sonuçlara göre korelasyon katsayı değerleri -1 ile +1 arasındadır. Elde edilen sonuçlar dönüştürücü liderlik ile inovasyon kültürü arasında ($r=,491$; $p<0.01$) pozitif yönde orta düzeyde bir ilişki olduğunu göstermektedir. Bu sonuca göre H1 hipotezi kabul edilir.

Dönüştürücü liderliğin vizyon ilham rol modeli olma boyutu ile inovasyon düzeyi arasında ($r=,456$; $p<0.01$) pozitif yönde düşük düzeyde, inovasyon kültürü arasında ($r=,562$; $p<0.01$) pozitif yönde orta düzeyde bir ilişki tespit edilmiştir. Bu sonuca göre H1_a hipotezi kabul edilir.

Dönüştürücü liderliğin grup amaçlarının kabulünü sağlama boyutu ile inovasyon düzeyi arasında ($r=,263$; $p<0.01$) ve inovasyon kültürü arasında ($r=,333$; $p<0.01$) pozitif yönde düşük düzeyde bir ilişki tespit edilmiştir. Bu sonuca göre H1_b hipotezi kabul edilir.

Dönüştürücü liderliğin entelektüel teşvik boyutu ile inovasyon düzeyi arasında ($r=,304$; $p<0.01$) pozitif yönde düşük düzeyde, inovasyon kültürü arasında ($r=,406$; $p<0.01$) pozitif yönde düşük düzeyde bir ilişki tespit edilmiştir. Bu sonuca göre H1_c hipotezi kabul edilir.

Dönüştürücü liderliğin bireysel ilgi boyutu ile inovasyon düzeyi arasında ($r=,376$; $p<0.01$) pozitif yönde düşük düzeyde, inovasyon kültürü arasında ($r=,387$; $p<0.01$) pozitif yönde düşük düzeyde bir ilişki tespit edilmiştir. Bu sonuca göre H1_d hipotezi kabul edilir.

Dönüştürücü liderliğin yüksek başarı beklentisi boyutu ile inovasyon düzeyi arasında ($r=180$; $p<0.05$) pozitif yönde düşük düzeyde, inovasyon kültürü arasında ($r=202$; $p<0.05$) pozitif yönde düşük düzeyde bir ilişki tespit edilmiştir. Bu sonuca göre $H1_c$ hipotezi kabul edilir.

Dönüştürücü liderliğin alt boyutları vizyon ilham rol modeli olma, grup amaçlarının kabulünü sağlama, entelektüel teşvik, bireysel ilgi ve yüksek başarı beklentisi arasında pozitif yönde orta düzeyde bir ilişki olduğu tespit edilmiştir. Dönüştürücü liderlik ile dönüştürücü liderlik boyutları arasında pozitif yönde oldukça kuvvetli bir ilişki tespit edilmiştir. Ayrıca inovasyon düzeyi ve inovasyon kültürü arasında pozitif yönde oldukça kuvvetli bir ilişki tespit edilmiştir.

4. SONUÇ VE ÖNERİLER

Günümüz koşullarında ekonomik büyüme ve rekabet edebilirlik giderek inovasyona dayanmaktadır. Uluslararası arenada var olabilmek ve rekabet üstünlüğünü elde edebilmek için ülkelerin hem inovatif girişimlere hem de bu konuda öncü işletmelere gereksinimi vardır (Elmacı ve Yalçın, 2012:62). Bu da ortak vizyon oluşturan ve paylaşan, entelektüel teşvikle yaratıcılığı geliştiren, karizmatik etkisiyle izleyenlerde saygı ve güven uyandıran, takım çalışmasına önem veren, kişisel risk üstlenebilen, esinsel motivasyonla izleyenleri harekete geçirerek gerekli inovasyon kültürünü oluşturabilen ve inovasyonu gerçekleştirebilen dönüştürücü liderleri gerektirmektedir. Bu noktadan hareketle bu çalışmada, dönüştürücü liderlik ve inovasyon kültürü arasındaki ilişkiyi belirlemeye yönelik Manisa Organize Sanayi Bölgesi'nde faaliyet gösteren büyük ölçekli işletmelere yönelik bir saha araştırması gerçekleştirilmiştir. Dönüştürücü liderlik ve inovasyon kültürü ilişkisini belirlemeye yönelik yapılan korelasyon analizinde, dönüştürücü liderlik ve alt boyutları (vizyon ilham rol modeli olma, grup amaçlarının kabulünü sağlama, entelektüel teşvik, bireysel ilgi, yüksek başarı beklentisi) ve inovasyon kültürü arasında pozitif yönlü ve anlamlı bir ilişki tespit edilmiştir. Bu kapsamda yöneticilerin dönüştürücü liderlik davranışları arttıkça işletmelerin inovasyon düzeyinin ve inovasyon kültürünün artacağı ifade edilebilir.

Elde edilen sonuçlar şu şekilde yorumlanabilir:

Dönüştürücü liderlik ile inovasyon kültürü arasında olumlu bir ilişki vardır. Bu sonuç, yöneticilerin dönüştürücü liderlik davranışlarını sergilediklerinde inovasyon kültürünün oluşturulması ve yaygınlaştırılması konusunda olumlu sonuçlar alınabileceğini göstermektedir.

Dönüştürücü liderliğin vizyon, ilham ve rol modeli olma boyutu ile inovasyon kültürü arasında olumlu bir ilişki vardır. Bu sonuç, liderin izleyenlerine, yapılan işlerin önemini açıklayarak ve anlamlı kılarak ilham vermesi, takım ruhunu oluşturması, örgütte coşku ve iyimserliği hakim kılması, paylaşılan bir vizyon ortaya koyması ve amaçların gerçekleşeceğine ilişkin inanç oluşturması durumunda inovasyon faaliyetleri konusunda olumlu sonuçlar alınabileceğini göstermektedir.

Dönüştürücü liderliğin entelektüel teşvik boyutu ile inovasyon kültürü arasında olumlu bir ilişki vardır. Bu sonuç, liderin izleyenlerini işlerin mevcut yapılış yöntemlerini, problemlerin çözümünde alışlagelmiş davranış ve düşünce kalıplarını sorgulamaya teşvik ettiğinde ve risk almaya cesaretlendirdiğinde yaratıcılık ve inovasyon konusunda olumlu sonuçlar alınabileceğini göstermektedir.

Dönüştürücü liderliğin grup amaçlarının kabulünü sağlama boyutu ile inovasyon kültürü arasında olumlu bir ilişki vardır. Bu sonuç, liderin izleyenleri birer takım üyesi olmalarını ve ortak bir amaç doğrultusunda çalışmalarını cesaretlendirerek, inovasyon çalışmalarına yönelik ekipler kurabildiğinde inovasyon faaliyetleri konusunda olumlu sonuçlar alınabileceğini göstermektedir.

Dönüştürücü liderliğin bireysel ilgi gösterme boyutu ve inovasyon kültürü arasında olumlu bir ilişki vardır. Bu sonuç, liderin izleyenlerinin her birine bireysel ilgi göstererek onların gereksinimlerini ve beklentilerini dikkate aldığı anda inovasyon kültürünün benimsenmesini kolaylaştıracağı için inovasyon faaliyetleri konusunda olumlu sonuçlar alınabileceğini göstermektedir.

Dönüştürücü liderliğin yüksek başarı beklentisi boyutu ile inovasyon kültürü arasında olumlu bir ilişki vardır. Bu sonuç, lider üstün performans göstermeleri konusunda izleyenlerine güven sağlar ve onları daha yüksek idealleri gerçekleştirmeye yöneltebilirse inovasyon faaliyetleri konusunda olumlu sonuçlar alınabileceğini göstermektedir.

Bu çalışma kapsamında şunlar önerilebilir:

Günümüzde inovasyon konusu tüm dünyada işletmelerin gündeminde olan en önemli konulardan birisidir. İşletmeler rekabette üstünlük sağlamak amacıyla tüm sektörlerde araştırma geliştirme (Ar-Ge) ve inovasyona daha fazla yatırım yapmaktadır. Dolayısıyla ülkemizdeki işletmeler rekabet güçlerini korumak için Ar-Ge faaliyetlerine daha fazla kaynak ayırabilirler.

Yöneticilere kriz dönemlerinde küçülmeye gitmek yerine dönüştürücü liderlik tarzını benimseyerek işletmeye değişim ve hareketlilik katacak inovasyon uygulamalarına odaklanmaları önerilebilir.

Bu projede inovasyon ve inovasyon kültürü dönüştürücü liderlik açısından irdelenmiştir. Bu konuda araştırma yapmayı düşünen araştırmacılar farklı bir liderlik tarzı perspektifinden ya da inovasyon kültürünün oluşmasında etkili olan başka faktörler açısından konuyu inceleyebilir.

Dönüştürücü liderlik ve inovasyon kültürü konusunda farklı örneklerle çalışılarak yeni araştırmalara ışık tutulabilir.

KAYNAKÇA

- Atik, H. (2005) “Yenilik ve Ulusal Rekabet Gücü”, Ankara: Detay Yayıncılık.
- Averill, J. R. (1999) “Individual Differences in Emotional Creativity: Structure and Correlates”, *Journal of Personality*, 67(2): 331-371.
- Aydın, E., ve Çakar, U. (2014) “Ekogirişimcilik ve Yaratıcılık İlişkisi: Geridönüşüm Sektörü Üzerinde Bir Araştırma”, *Celal Bayar Üniversitesi Yönetim ve Ekonomi Dergisi*, 21(1): 77-89.
- Buzan, T. ve Keane, R. (1966) “Dehanın El Kitabı”, İstanbul: Sabah Yayınları.
- Çelik, S. ve Eryılmaz, F. (2006) “Öğretmen Algılarına Göre Endüstri Meslek Lisesi Müdürlerinin Dönüşümcü Liderlik Düzeyleri (Ankara İli Örneği)”, *Politeknik Dergisi*, 9(4): 211-224.
- Çetin, F., Şeşen, H. ve Basım, H. N. (2013) “Örgütsel Psikolojik Sermayenin Tükenmişlik Sürecine Etkileri: Kamu Sektöründe Bir Araştırma”, *Anadolu Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi*, 13(3): 95-108.
- Çetinkaya, Ö., ve Alparslan, A. M. (2011) “Duygusal Zekanın İletişim Becerileri Üzerine Etkisi: Üniversite Öğrencileri Üzerinde Bir Araştırma”, *Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi*, 16(1): 363-377.
- Elmacı, O., ve Yalçın, M. (2012) “Measuring Innovation Power of Businesses: A Regional Research in Food and Agricultural Industry”, *Tübitak Ulakbim Dergipark, İktisat Fakültesi Mecmuası*, 62(2): 61-78.
- Eraslan, L. (2004) “Liderlikte Post-Modern Bir Paradigma: Dönüşümcü Liderlik”, *Uluslararası İnsan Bilimleri Dergisi*, 1(1): 1-32.
- Gandotra, N. K. (2010) “Innovation culture for sustainable competitive advantage”, *Asia Pacific Journal of Research in Business Management*, 1(2): 51-59.
- Gökçe, G. S. (2010) “İnovasyon Kavramı ve İnovasyonun Önemi”, http://fka.gov.tr/sharepoint/userfiles/Icerik_Dosya_Ekleri (Erişim Tarihi: 26.12.2017)
- Gündüz, R. (1998) “Değişimde Liderlik”, *Dokuz Eylül Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Yayınlanmış Yüksek Lisans Tezi*, İzmir.
- Güney, S. (2000) “Yönetim ve Organizasyon El Kitabı”, Ankara: Nobel Yayın Dağıtım.
- İşcan, Ö. F. (2002) “Küresel İşletmecilikte Dönüştürücü Liderlik Anlayışı”, *Yayınlanmamış Doktora Tezi*, Atatürk Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Erzurum.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

İyigün, N. Ö. (2015) “İnovasyon & Stratejik Rekabet Üstünlüğü”,
<http://www.datalink.com.tr/toprakisveren/2015-108-oykuiyigun.pdf> (Erişim Tarihi:
03.11.2017)

Karcioğlu, F., ve Kaygın, E. (2013) “Dönüştürücü Liderlik Anlayışının Yaratıcılığa ve Yeniliğe Etkisi”,
Kafkas Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 4(5): 99-111.

Keçecioglu, T. (2003) “Lider&Liderlik”, İstanbul: Okumuş Adam Yayıncılık.

Koçel, T. (1998) “İşletme Yöneticiliği”, İstanbul: Beta Basım Yayım Dağıtım.

Koçel, T. (2005) “İşletme Yöneticiliği, Yönetici Geliştirme, Organizasyon ve Davranış”, İstanbul:
Arıkan Basım Yayın Dağıtım.

Losane, L. (2013) “Innovation Culture-Determinant of Firms' Sustainability”, International Journal of
Economics and Management Engineering, 7(10): 2755-2760.

Luthans, F., Avey, J. B., Avolio, B.J. & Peterson, S. (2010) “The Development and Resulting
Performance Impact of Positive Psychological Capital”, Human Resource Development
Quarterly, 21(1): 41-67.

Menguc, B., Auh, S., ve Shih, E. (2007) “Transformational Leadership and Market Orientation:
Implications for The Implementation of Competitive Strategies and Business Unit Performace”,
Journal of Business Research, 60: 314-321

Oke, A., Munshi, N. and Walumbwa, F. O. (2009) “The Influence Of Leadership On Innovation
Processes And Activities”, Organizational Dynamics, 38 (1): 64-72.

O'Reilly, C. A., Chatman, J. A. and Caldwell, D. F. (1991) “People and Organizational Culture: A Profile
Comparison Approach to Assessing Person-Organization Fit”, Academy of Management
Journal, 34: 487-516.

Oslo Kılavuzu, (2005) “Yenilik Verilerinin Toplanması ve Uygulanması İçin İlkeler”. 3. Baskı. OECD-
EUROSTAT Ortak Yayımı, Ankara: TÜBİTAK.

Özalp, İ., Koparal, C. ve Berberoğlu, G. (1996) “Yönetim ve Organizasyon”, Eskişehir: Anadolu
Üniversitesi A.Ö.F. Yayınları.

Özkara, B.(1999) “Evrimci ve Devrimci Örgütsel Değişim”, Afyon: Afyon Kocatepe Üniversitesi
Yayınları.

Podsakoff, P. M., MacKenzie, S. B., ve Bommer, M. H. (1996) “Transformational Leader Behaviors
and Substitutes For Leadership as Determinants of Employee Satisfaction, Commitment, Trust
and Organizational Citizenship Behaviors”, Journal of Management, 22(2): 259-298.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Robbins, S. P., and Judge, T. A. (2011) "Organizational Behavior ", (14. Baskı). (Çev.. İnci Erdem)
New Jersey: Pearson Education.

Seligman, M. E. P. (1998) "Learned Optimism", New York: Pocket Books.

Snyder, N. H. ve Graves, M. (1994) "Leadership and Vision", Busi Horizons, 37(1): 1-7.

Tekin, M. (2014) "Girişimcilik", Konya: Eralp Yayın ve Dağıtım.

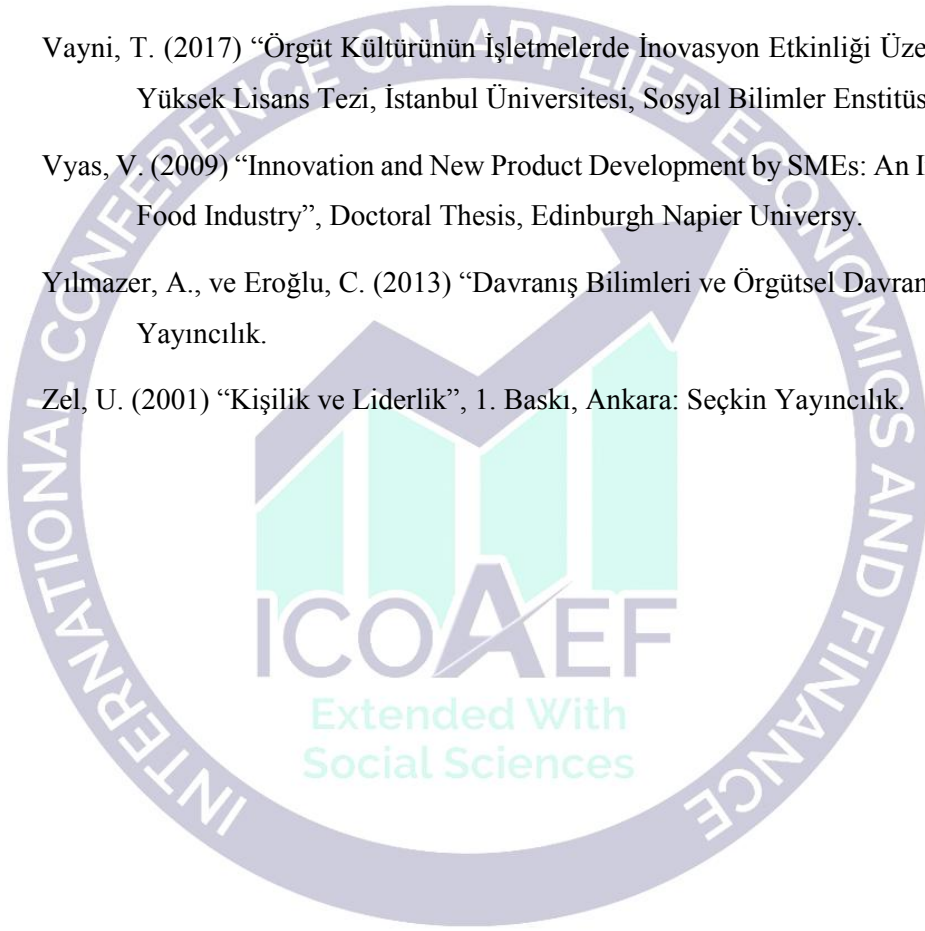
Tichy, N. M., and Devanna, M. A. (1986) "The Transformational Leader", New York:Wiley.

Vayni, T. (2017) "Örgüt Kültürünün İşletmelerde İnovasyon Etkinliği Üzerine Etkisi: Bir Araştırma",
Yüksek Lisans Tezi, İstanbul Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, İstanbul.

Vyas, V. (2009) "Innovation and New Product Development by SMEs: An Investigation of The Scottish
Food Industry", Doctoral Thesis, Edinburgh Napier University.

Yılmaz, A., ve Eroğlu, C. (2013) "Davranış Bilimleri ve Örgütsel Davranış", 4.Baskı, Ankara: Detay
Yayıncılık.

Zel, U. (2001) "Kişilik ve Liderlik", 1. Baskı, Ankara: Seçkin Yayıncılık.



KONAKLAMA İŞLETMELERİNİN DEĞERLENDİRİLMESİ

Doç. Dr. Serkan Bertan*

Dr. Öğr. Üyesi Serap Alkaya**

ÖZET

Bu çalışmanın amacı; konaklama işletmelerini değerlendirmektir. Termal tesislerde ve/veya belediye belgeli tesislerde konaklayanlar, işletmenin bulunduğu yeri, uyku kalitesini, odaları, temizliği, değeri ve genel değerlendirmeyi daha olumlu bakmaktadırlar. Japonlar, İngiliz, Türk, Amerikalı, Kanadalı ve Avustralyalı kullanıcılara göre konaklama işletmelerinin yerini uygun bulmuşlar, verilen hizmeti beğenmişler ve verdikleri ücretin değiştiğini düşünmektedir. Bunun yanında Japonlar, Kanadalılara göre, uyku kalitesinin, odaların, temizliğin ve genel olarak işletmelerin daha iyi olduğunu düşünmektedirler.

Anahtar Kelimeler: Konaklama Tesisleri, Milliyet, Termal, Pamukkale, Denizli.

JEL Kodları: M30, M31, M33.

EVALUATION OF ACCOMMODATION BUSINESS

ABSTRACT

The purpose of this study is to examine online reviews on accommodation facilities in Pamukkale destination and to evaluate the mostly used words in reviews. Considering online reviews with regard to facilities, it is concluded that visitors accommodating in thermal facilities and/or facilities with municipal licence are more positive towards the location, sleep quality, cleanliness, value and overall evaluation. Considering online reviews with regard to nationalities, Japanese visitors regard the location of facilities more appropriate than British, Turkish, American, Canadian and Australian visitors; they appreciate the service offered more and they think that the price they have paid is worth. On the other hand, Japanese visitors consider sleep quality, rooms, cleanliness and overall situation of facilities better than Canadians.

Keywords: Accommodation Facilites, Nationality, Thermal, Reviews, Pamukkale, Denizli.

JEL Codes: M30, M31, M33.

* Pamukkale Üniversitesi, Turizm Fakültesi, Turizm İşletmeciliği, serkanbertan@yahoo.com

** Pamukkale Üniversitesi, Turizm Fakültesi, Turizm İşletmeciliği, salkaya@yahoo.com

1. GİRİŞ

Tüketim sonrası değerlendirmeler sonucunda ürünle ilgili bilgi ve araştırma imkanı sağlayan ürünlerle ilgili deneyimlerin ve düşüncelerin paylaşılmasıyla tüketicilere fayda sağlayan yorumlar, seyahat edenler için otel seçimlerinde, satın alma karar aşamasında dikkate alınmakta ve önemli rol oynamaktadır (Stringham, Gerdes ve Vanleeuwen, 2010; Cao, Duan ve Gan, 2011; Ganu, Kakodkar ve Marian, 2013; Korfiatis ve Poulos, 2013; Ye, Li, Wang ve Law, 2014).

Günümüzde birçok ürüne ait yorum bulunmakta, yorum sayıları hızlı bir şekilde artmasına rağmen önemi de giderek artmakta, işletmelerin performansı üzerine kullanıcı yorumlarının etkisi, yorumların olumlu veya olumsuz olup olmaması, yorum içerikleri ve özellikle olumsuz yorumların etkisini üzerine odaklanılmıştır (Stringam vd., 2010; Ye vd., 2011; Filieri ve McLeay, 2013; Melian-Gonzalez, Bulchand-Gidumal ve Lopes-Valcarcel, 2013; Ye vd., 2014).

2. LİTERATÜR TARAMASI

Günümüzde tüketicilerin alışveriş alışkanlıkları değiştiğinden, konaklama hizmetleri ve diğer turizmle ilgili ürünler hakkında bilgi almada, değerlendirmede yorumlar tüketiciler için önemli bilgi kaynağı oluşturmakta, rezervasyon işleminde ve ürünler için deneyimlerin değerlendirilmesi açısından tüketicilere çok önemli bilgi sağlayan yorumların kullanımı giderek artmaktadır (Ong, 2012; Racherla, Mandviwalla ve Connolly, 2012; Filieri ve McLeay, 2013; Sezgin, 2013; Korfiatis ve Poulos, 2013). Satın alma niyeti üzerinde, müşteri kararlarında, satışlar üzerinde, müşteri ilişkilerinde ve marka algılamasında, satışlarda çekim gücü oluşturmada, e-pazarlamada etkileri bulunan yorumlar tüketicilere karar verme aşamasında güven vermekte, riski azaltmakta ve karar vermelerine yardımcı olmaktadır (Gretzel, Yoo ve Purifoy, 2007; Ye vd., 2011; Papathanassis ve Knolle, 2011; Cui, Lui ve Guo, 2012; Mauri ve Minazzi, 2013).

Rezervasyon aşamasında karar vermeyi etkileyen yorumların satın alma niyeti üzerinde olumlu bir etkisi bulunmakta, yüksek puanlar otellerin satışlarını arttırmasına rağmen olumsuz yorumlar tüketiciler için daha faydalı olmakta ve satın almada daha etkili olmaktadır (Öğüt ve Taş, 2012; Cui vd., 2012; Filieri ve McLeay, 2013; Mauri ve Minazzi, 2013). Tüketici kararlarında önemi giderek artan yorumların daha iyi anlaşılması gerekliliğini ortaya çıkarmış yorumlar tüketicilerin otel tercihlerinde öne çıkan bir hal almaktadır (Papathanassis ve Knolle, 2011; Anderson, 2012; Melian-Gonzalez vd., 2013).

3. ARAŞTIRMA YÖNTEMİ VE BULGULARI

Bu çalışmada, milyonlarca yoruma sahip, araştırmacılar tarafından geniş bir şekilde incelendiğinden (Banerjee ve Chua, 2016; Zhang, Ji, Wang ve Chen, 2017) dolayı TripAdvisor web sayfasında Pamukkale'de bulunan konaklama tesisleri ile ilgili yorumlar incelenmiştir. Kullanıcı yorumlarına; tesislere göre farklılıkların araştırılması için t testi analizi ve milliyetlerin etkisinin araştırılması için tek

yönlü varyans analizi uygulanmıştır. Kullanıcı yorumlarının tesislere ve milliyetlerine göre incelendiğinde anlamlı farklılıklar ortaya çıkmıştır.

Tablo 1. Kullanıcı Yorumlarının Belediye ve İşletme Belgeli Tesislere Göre Karşılaştırılması

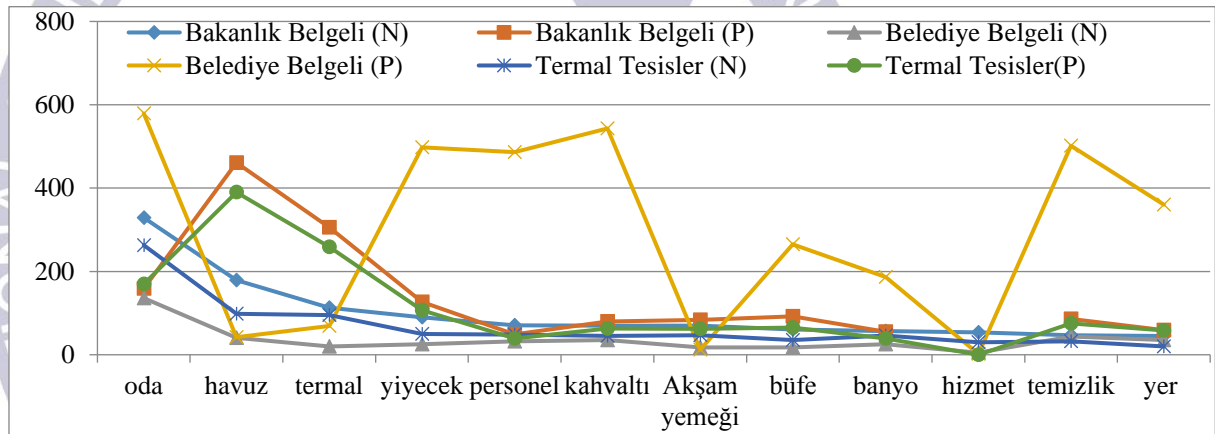
| İfadeler | | Ort. | t | p |
|---------------|------------------|--------|--------|------|
| Yer | Belediye Belgeli | 4,3314 | 20,591 | ,001 |
| | İşletme Belgeli | 3,4067 | | |
| Uyku Kalitesi | Belediye Belgeli | 4,0384 | 12,539 | ,001 |
| | İşletme Belgeli | 3,3372 | | |
| Odalar | Belediye Belgeli | 3,8007 | 12,619 | ,001 |
| | İşletme Belgeli | 3,1295 | | |
| Temizlik | Belediye Belgeli | 4,1175 | 13,565 | ,001 |
| | İşletme Belgeli | 3,4284 | | |
| Hizmet | Belediye Belgeli | 4,1605 | 21,334 | ,001 |
| | İşletme Belgeli | 3,0660 | | |
| Değer | Belediye Belgeli | 4,1720 | 22,590 | ,001 |
| | İşletme Belgeli | 3,0222 | | |
| Genel | Belediye Belgeli | 4,0206 | 17,161 | ,001 |
| | İşletme Belgeli | 3,1515 | | |

Tablo 2. Kullanıcı Yorumlarının Termal ve Diğer Tesislere Göre Karşılaştırılması

| İfadeler | | Ort. | t | p |
|---------------|--------------|--------|--------|------|
| Yer | Termal Tesis | 4,0789 | 14,679 | ,001 |
| | Diğer | 3,4094 | | |
| Uyku Kalitesi | Termal Tesis | 3,8565 | 9,812 | ,001 |
| | Diğer | 3,3247 | | |
| Odalar | Termal Tesis | 3,6471 | 10,592 | ,001 |
| | Diğer | 3,0961 | | |
| Temizlik | Termal Tesis | 3,9643 | 11,443 | ,001 |
| | Diğer | 3,3976 | | |
| Hizmet | Termal Tesis | 3,8891 | 16,227 | ,001 |
| | Diğer | 3,0468 | | |
| Değer | Termal Tesis | 3,8813 | 16,540 | ,001 |
| | Diğer | 3,0154 | | |
| Genel | Termal Tesis | 3,7806 | 12,333 | ,001 |
| | Diğer | 3,1591 | | |

Belediye ve işletme belgeli tesislere göre yer, uyku kalitesi, odalar, temizlik, hizmet, değer ve genel değerlendirme arasında anlamlı farklılık vardır. “Yer, uyku kalitesi, odalar, temizlik, değer ve genel değerlendirme” ifadelerine işletme ve belediye belgeli oteller açısından fark istatistikî olarak anlamlı bulunmuştur ($p < .001$). Belediye belgeli tesislerde konaklayanlar, işletmenin bulunduğu yeri, uyku kalitesini, odalarını, temizliğini, değeri ve genel değerlendirmeyi daha olumlu düşünmektedirler. Termal ve diğer tesislere göre yer, uyku kalitesi, odalar, temizlik, hizmet, değer ve genel değerlendirme arasında anlamlı farklılık vardır. “Yer, uyku kalitesi, odalar, temizlik, değer ve genel değerlendirme” ifadelerine termal ve diğer tesisler açısından fark istatistikî olarak anlamlı bulunmuştur ($p < .001$). Termal tesislerde kalanlar, yer, uyku kalitesi, odalar, temizlik, değer ve genel değerlendirme ifadelerine daha olumlu değerlendirmektedirler ($p < .001$).

Grafik 1. Tesislere Göre Yorumlarda En Sık Kullanılan Kelimeler



Tesislere göre online yorumlarda en sık kullanılan kelimeler incelendiğinde; oda, personel, banyo kelimelerini bakanlık belgeli ve termal tesislerde olumsuz, belediye belgeli tesislerde olumlu yorumlarda; havuz, akşam yemeği, termal kelimesi bakanlık belgeli ve termal tesislerde olumlu, belediye belgeli tesislerde olumsuz yorumlarda; yiyecek, kahvaltı, büfe, termal, temizlik ve yer kelimeleri işletme, belediye belgeli ve termal tesislerde olumlu yorumlarda; hizmet kelimesi işletme, belediye belgeli ve termal tesislerde olumsuz yorumlarda daha sık kullanılmıştır. Kullanıcı yorumlarına, milliyetlerin etkisinin araştırılması için tek yönlü varyans analizi uygulanmıştır. Kullanıcı yorumları, milliyetlerine göre incelendiğinde anlamlı farklılıklar ortaya çıkmıştır.

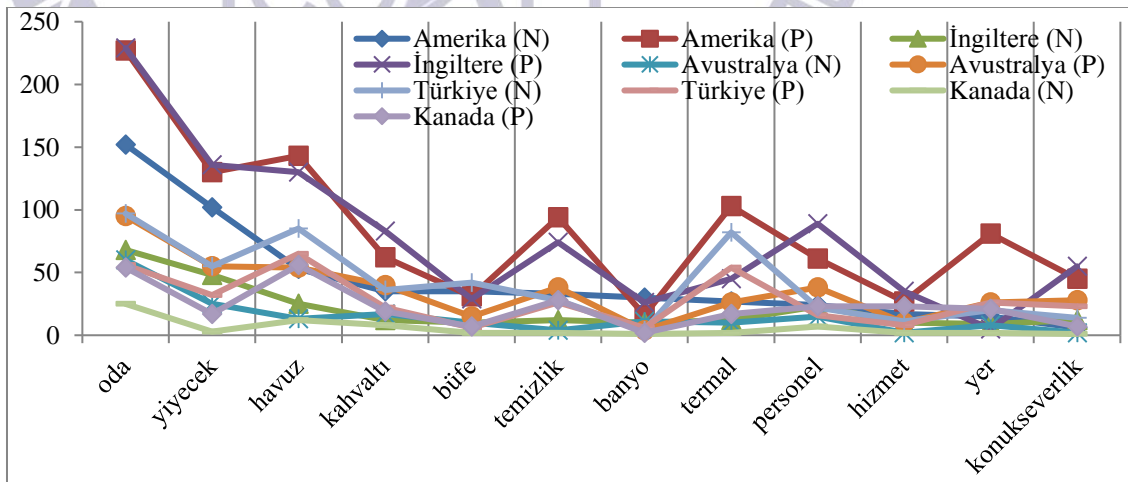
Tablo 3. Kullanıcı Yorumlarının Milliyetlerine Göre Karşılaştırılması

| İfadeler | Milliyetler | | |
|---------------|-------------|------|---------------------|
| | F | p | Scheffe |
| Yer | 10,865 | ,001 | 5-1,5-2,5-3,5-4,5-6 |
| Uyku Kalitesi | 3,423 | ,002 | 5-4 |
| Odalar | 5,065 | ,001 | 5-4 |

| | | | |
|---------------------|--------|------|---------------------|
| Temizlik | 5,824 | ,001 | 5-4 |
| Hizmet | 11,055 | ,001 | 5-1,5-2,5-3,5-4,5-6 |
| Değer | 7,989 | ,001 | 5-1,5-2,5-3,5-4,5-6 |
| Genel Değerlendirme | 4,392 | ,001 | 5-4 |

Milliyetlere göre yer, uyku kalitesi, odalar, temizlik, hizmet, değer ve genel değerlendirme arasında anlamlı farklılık vardır. “Yer” ifadesine katılımcıların milliyetleri açısından tutumları incelendiğinde anlamlı farklılıklar bulunmuştur ($F=10,865$, $p<.001$). Japonlar, İngiliz, Türk, Amerikalı, Kanadalı ve Avustralyalı kullanıcılara göre işletmelerin yerini uygun bulmuşlardır. “Uyku kalitesi, odalar ve temizlik ” ifadesine katılımcıların milliyetleri açısından tutumları incelendiğinde anlamlı farklılıklar bulunmuştur ($F=3,423$; $5,065$; $5,824$, $p<.001$). Japonlar, Kanadalılara göre, uyku kalitesinin, odaların ve temizliğin daha iyi olduğunu düşünmektedir. “Hizmet ve Değer” ifadesine katılımcıların milliyetleri açısından tutumları incelendiğinde anlamlı farklılıklar bulunmuştur ($F=10,865$, $p<.001$). Japonlar, İngiliz, Türk, Amerikalı, Kanadalı ve Avustralyalı kullanıcılara göre verilen hizmeti beğenmişler ve verdikleri ücretin değdiği düşünmektedirler. “Genel değerlendirme” ifadesine katılımcıların milliyetleri açısından tutumları incelendiğinde anlamlı farklılıklar bulunmuştur ($F=4,392$, $p<.001$). Japonlar, Kanadalılara göre, genel olarak işletmelerin daha iyi olduğunu düşünmektedir.

Grafik 2. Milliyetlere Göre Yorumlarda En Sık Kullanılan Kelimler



Milliyetlere göre olumlu veya olumsuz yorumlarda en sık kullanılan kelimeler incelendiğinde; oda, yiyecek, havuz, kahvaltı, temizlik, termal, personel ve hizmet kelimelerini Amerikalılar, İngilizler, Avustralyalılar, Kanadalılar daha çok olumlu yorumlarda, Türkler ise olumsuz yorumlarda; Büfe kelimesini İngilizler, Avustralyalılar, Kanadalılar daha çok olumlu, Amerikalılar, Türkler olumsuz

yorumlarda; banyo kelimesini İngilizler, Türkler, Kanadalılar olumlu, Amerikalılar, Avustralyalılar, olumsuz yorumlarda; yer kelimesini Amerika, Avustralya, Türkler, Kanadalılar olumlu, İngilizler ve Kanadalılar olumsuz yorumlarda; konukseverlik kelimesini Amerikalılar, İngilizler, Avustralyalılar, Türkler ve Kanadalılar olumlu yorumlarda kullanmışlardır.

4. SONUÇ VE ÖNERİLER

Belediye belgeli tesislerde konaklayanlar, işletmenin bulunduğu yeri, uyku kalitesini, odalarını, temizliğini, değeri ve genel değerlendirmeyi daha olumlu düşünmektedirler. Termal tesislerde kalanlar, yer, uyku kalitesi, odalar, temizlik, değer ve genel değerlendirme ifadelerine daha olumlu değerlendirmektedirler. İşletme ve belediye belgeli tesislere ait yorumlarda en sık kullanılan kelimeler incelendiğinde, oda daha sonra havuz kelimesi gelmektedir. Daha sonra sırasıyla işletme belgeli otellerde yiyecek, personel, kahvaltı, akşam yemeği, büfe, banyo, termal, hizmet, temizlik ve yer kelimeleri yer almaktadır. Belediye belgeli otellerde kahvaltı, yer, personel, temizlik, banyo, yiyecek ve yer kelimeleri gelmektedir. Termal tesisler için yazılan yorumlarda olumsuz olarak kullanılan kelimeler incelendiğinde, ilk sırada oda, daha sonra havuz, termal, yiyecek, personel, akşam yemeği, banyo, kahvaltı, büfe, temizlik ve hizmet kelimeleri gelmektedir. İşletme ve belediye belgeli otellerde olumlu yorumlarda en sık kullanılan kelimeler incelendiğinde; işletme belgeli tesislerde havuz ilk sırada yer alırken, termal ikinci sırada sonra sırasıyla oda, yiyecek, termal, temizlik, akşam yemeği, kahvaltı, yer, banyo, personel kelimeleri yer almaktadır. Belediye belgeli tesislerde ilk sırada oda, daha sonra sırasıyla havuz, kahvaltı, temizlik, yiyecek, personel, yer, termal, büfe, hizmet, termal, banyo, yer kelimeleri gelmektedir. Termal tesisler için yazılan olumlu yorumlarda kelimeler incelendiğinde havuz, termal, yiyecek, temizlik, büfe, kahvaltı, akşam yemeği, yer, personel ve banyo kelimeler gelmektedir. İşletme belgeli ve termal tesislerde oda, personel, banyo kelimelerini olumsuz yorumlarda, belediye belgeli tesislerde olumlu yorumlarda; havuz, akşam yemeği, termal kelimesi işletme belgeli ve termal tesislerde olumlu, belediye belgeli tesislerde olumsuz yorumlarda; yiyecek, kahvaltı, büfe, termal, temizlik ve yer kelimeleri işletme, belediye belgeli ve termal tesislerde olumlu yorumlarda; hizmet kelimesi işletme, belediye belgeli ve termal tesislerde olumsuz yorumlarda daha sık kullanılmıştır.

Japonlar, işletmelerin yerini uygun bulmuşlar, verilen hizmeti beğenmişler ve verdikleri ücretin değiştiğini düşünmektedirler fakat diğer ziyaretçiler için aynı şeyi söylemek mümkün değildir. Japonlar, Kanadalılara göre, uyku kalitesinin, odaların, temizliğin ve genel olarak işletmelerin daha iyi olduğunu düşünmektedirler. Amerikalılar, İngilizler, Avustralyalılar, Kanadalılar daha çok olumlu yorumlarda oda, yiyecek, havuz, kahvaltı, temizlik, termal, personel ve hizmet kelimelerini, Türkler ise bu kelimeleri olumsuz yorumlarda kullanmaktadırlar. Büfe kelimesini, İngilizler, Avustralyalılar, Kanadalılar daha çok olumlu yorumlarda, Amerikalılar ve Türkler olumsuz yorumlarda ele almıştır. Banyo kelimesini, İngilizler, Türkler, Kanadalılar olumlu, Amerikalılar ve Avustralyalılar olumsuz yorumlarda; yer

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

kelimesini Amerika, Avustralya, Türkler, Kanadalılar olumlu, İngilizler ve Kanadalılar olumsuz yorumlarda; konukseverlik kelimesini Amerikalılar, İngilizler, Avustralyalılar, Türkler ve Kanadalılar olumlu yorumlarda kullanmışlardır.

KAYNAKÇA

Anderson, C. K. (2012) "The Impact of Social Media on Lodging Performance", Cornell Hospitality Report, 12(15).

Banerjee, S. ve Chua, A. Y. (2016) "In Search of Patterns Among Travellers' Hotel Ratings in Trip Advisor", Tourism Management, 53: 125-131.

Cao, Qing; Duan, Wenjing ve Gan, Qiwei. (2011) "Exploring Determinants of Voting for the "Helpfulness" of Online user Reviews: A text Mining Approach Decision Support Systems", 50: 511-521.

Cui, Geng; Lui, Hon-Kwong ve Guo, Xiaoning. (2012) "The Effect of Online Consumer Reviews on New Product Sales", International Journal of Electronic Commerce, 17(1): 39-57.

Filieri, R. ve McLeay, F. (2013) "E-WOM and Accommodation: An Analysis of the Factors That Influence Travelers' Adoption of Information from Online Reviews", Journal of Travel Research, 53(1): 44-57.

Ganu, G., Kakodkar, Y. ve Marian, A. (2013) "Improving the Quality of Predictions Using Textual Information in Online User Reviews", Information Systems, 38: 1-15.

Gretzel, U., Yoo, K. ve Purifoy, M. (2007) "Online Travel Review Study: The Role and Impact of Online Travel Reviews. Laboratory for Intelligent Systems in Tourism", Texas A&M University.

Korfiatis, N. ve Poulos, M. (2013) "Using Online Consumer Reviews as a Source for Demographic Recommendations: A Case Study Using Online Travel Reviews", Expert Systems with Applications, 40: 5507-5515.

Mauri, A. G. ve Minazzi, R. (2013) "Web Reviews Influence on Expectations and Purchasing Intentions of Hotel Potential Customers", International Journal of Hospitality Management, 34: 99-107.

Melian-Gonzalez, S., Bulchand-Gidumal, J. ve Lopes-Valcarcel, B. G. (2013) "Online Customer Reviews of Hotels: As Participation Increases, Better Evaluation Is Obtained", Cornell Hospitality Quarterly, 54(3): 274-283.

Öğüt, H. ve Taş, B. K. O. (2012) "The Influence of Internet Customer Reviews on the Online Sales and Prices in Hotel Industry", The Service Industries Journal, 32(2): 197-214.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Papathanassis, A. ve Knolle, F. (2011) "Exploring the Adoption and Processing of Online Holiday Reviews: A Grounded Theory Approach", *Tourism Management*, 32: 215-224.

Racherla, P, Mandviwalla, M. ve Connolly, D. J. (2012) "Factors Affecting Consumers' Trust in Online Product Reviews". *Journal of Consumer Behaviour*, *Journal of Consumer Behaviour*, 11: 94-104, DOI: 10.1002/cb.385.

Sezgin, E. (2013) "Travel Review Websites as Information Resources Perceived by Consumers", *Journal of China Tourism Research*, 9: 353–364, DOI:10.1080/19388160.2013.812902.

Stringham, Betsy Bender; Gerdes, John and Vanleeuwen, Dawn M. (2010). Assessing the Importance and Relationships of Ratingson User-Generated Traveler Reviews, *Journal of Quality Assurance in Hospitality & Tourism*, 11, pp. 73–92, DOI: 10.1080/1528008X.2010.482000.

Ye, Q., Li, H., Wang, Z. ve Law, R. (2014) "The Influence of Hotel Price on Perceived Service Quality and Value in E-Tourism: An Empirical Investigation Based on Online Traveler Reviews", *Journal of Hospitality & Tourism Research*, 38(1): 23-39.

Zhang, H. Y., Ji, P., Wang, J. Q., ve Chen, X. H. (2017) "A Novel Decision Support Model for Satisfactory Restaurants Utilizing Social Information: A Case Study of TripAdvisor.com", *Tourism Management*, 59: 281-297.

ICOAEF
Extended With
Social Sciences

TÜKETİCİLERİN REZERVASYON KARARINI ETKİLEYEN FAKTÖRLER

Doç. Dr. Serkan Bertan*

Dr. Öğr. Üyesi Serap Alkaya**

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, tüketicilerin rezervasyon kararını etkileyen faktörleri incelemektir. Pamukkale'ye gelen yerli ve yabancılara uygulanan ön uygulama sonrası anket formuna gerekli değişiklikler yapılarak ziyaretçilere uygulanmıştır Pamukkale'ye gelen yerli ve yabancı ziyaretçilere anket yüz yüze görüşme ile uygulanmıştır. Geçerlilik ve güvenilirlik analizinden sonra faktör analizi uygulanmış dört faktör (ürün, kullanıcı, işletme ve tatil süreci) oluşmuştur. Regresyon analizi sonucunda otel rezervasyonunu etkileyen faktörler sırasıyla ürün, kullanıcı, işletme ve tatil sürecidir.

Anahtar Kelimeler: *Tüketici, Rezervasyon Kararı, Rezervasyon, Pamukkale, Denizli.*

JEL Kodları: *M30, M31, M33*

FACTORS AFFECTING THE REZERVATION DECISION OF CONSUMERS

ABSTRACT

The aim of this study is to examine the factors affecting reservation decision. After the preliminary application, the questionnaire was finalized and applied to the visitors. Domestic and foreign visitors to Pamukkale were interviewed by face-to-face interviews. After the validity and reliability analysis, factor analysis was applied to four factors. The factors affecting the booking as a result of regression analysis are product, user, operation and holiday process respectively.

Key Words: *Consumer, Rezervation Decision, Rezervation, Pamukkale, Denizli.*

JEL Codes: *M30, M31, M33*

1.GİRİŞ

Son yıllarda internet kullanımının artmasıyla birlikte, tüketicilerin gidecekleri yerler hakkında önceden araştırma yaparak bilgi sahibi olduklarından dolayı turizm faaliyetlerine katılanların sayısında büyük bir artış gözlemlenmektedir. Bu nedenle turistlerin deneyimlerini paylaştıkları uygulamalar ve web siteleri de oldukça popüler hale gelmektedir (Saçlı, Efe, Sunar ve Ersöz, 2018: 2). Ziyaretçilerin sayısı böylesine hızla artarken, globalleşme, teknolojinin ilerlemesi ve rekabetin artması gibi nedenlerle turizm işletmeleri, dünya pazarından daha büyük paylar alabilmek için ciddi bir rekabet ortamı içine

* Pamukkale Üniversitesi, Turizm Fakültesi, Turizm İşletmeciliği, serkanbertan@yahoo.com

** Pamukkale Üniversitesi, Turizm Fakültesi, Turizm İşletmeciliği, salkaya@yahoo.com

girmiştir. Bu rekabet ortamında amaçlarına ulaşabilmek için tüketicilerin davranışları ve bu davranışları tetikleyen unsurları öğrenmek turizm işletmeleri açısından son derece önemlidir (Demir ve Kozak, 2011: 19).

2.LİTERATÜR TARAMASI

Tüketiciler ürün ya da hizmeti satın alma kararında daha önce kullanmış olan diğer tüketicilerin görüş ve önerilerine önem verdiklerinden internet ortamını bilgi araştırmaları için yoğun olarak kullanmakta, web siteleri aracılığıyla araştırmalar yapmakta ve kullanıcı deneyimlerinin paylaşıldığı sitelerinden oldukça yoğun faydalanmaktadır (Ergenekon Arslan ve Güven, 2018: 280; Sü Eröz ve Doğdubay, 2012: 133; Summak, Sunar ve Coşkuner, 2017: 836; Vural ve Bat, 2010: 3372). Teknolojik ilerlemelerle birlikte tüketiciler yolculuklarını planlamadan önce internetten araştırmalar yapmakta, tatil kararlarını verirken kendi geçmiş deneyimlerinin haricinde, çok sayıda kaynaktan bilgi toplamakta, topladıkları tüm bu bilgiler ışığında son kararlarını vermektedirler (Ateş, Kılınç ve Sunar, 2016: 470; Çakıcı ve Aksu, 2007: 184).

Hem internet hem de sosyal medya araçları, turizm işletmelerinin tüketicilerin konaklayacakları yerleri seçmelerinde önemli pazarlama aracı olarak karşımıza çıkmakta, özellikle gençler arasında oldukça popüler olan sosyal medya, tatil tercihlerinin yapılması aşamasında yararlı bir kaynak niteliği taşımaktadır (Aymanıuy, Soydaş ve Saçlı, 2013: 376; Erol ve Hassan, 2014: 804; Eşitti ve Işık, 2015: 11; Sunar, Gökçe, Cihangir, Summak ve Altunöz Sürücü, 2018: 1413; Sü Eröz ve Doğdubay, 2012: 133;). Web sitelerinin popüleritesinin artmasıyla tüketicilerin seyahat ile ilgili bilgileri aramaları ve değerlendirme yöntemleri de değişmeye başlamış, günümüzde dünyada ki birçok otel işletmesi bu gelişimin farkına varmalarıyla birlikte satışlarını artırabilmek için sosyal medyayı kullanmaya başlamıştır (Cinnioğlu ve Boz, 2015: 250; Cox, Burgess, Sellitto ve Buultjens, 2009: 744).

3.ARAŞTIRMA YÖNTEMİ

Tüketicilerin rezervasyon kararını etkileyen faktörleri incelemek amacıyla yapılan bu araştırmada literatürden elde edilen bilgilere dayanarak hazırlanan soru formu Pamukkale'ye gelen yerli ve yabancı ziyaretçilere uygulanmıştır. Soru formunda öncelikle çalışmanın amacı açıklanmış, bilimsel amaçlı yapıldığına vurgu yapılmış ve ön uygulama yapılmıştır. Anket yolu ile toplanan veriler kontrol edilmiş, eksik verilerin rastgele olup olmadığı, veri setinin normal dağılıp dağılmadığı incelenmiş, istatistik program ile faktör ve regresyon analizi yapılmıştır.

4.ARAŞTIRMANIN BULGULARI

Ankete cevap veren ziyaretçilerin %46,8'i kadın, %53,2'si erkektir. Katılımcıların çoğunlukla 26-35 yaş grubunda, lisans mezunu ve yılda 3-4 kez seyahat eden kişilerden oluşmaktadır.

Tablo 1. Demografik Bulgular

| Demografik Faktörler | % | Demografik Faktörler | % |
|----------------------|------|-------------------------------|------|
| CİNSİYET | | ÖĞRENİM DURUMU | |
| Kadın | 46,8 | Lise | 23,1 |
| Erkek | 53,2 | Ön Lisans | 14,7 |
| | | Lisans | 49,1 |
| | | Lisans Üstü | 12,9 |
| YAŞ | | Seyahat sayısı (Geçmiş 12 ay) | |
| 25 yaş ve altı | 11,4 | Hiç | 4,0 |
| 26-30 | 20,3 | 1-2 kez | 17,1 |
| 31-35 | 20,3 | 3-4 kez | 43,8 |
| 36-40 | 13,7 | 5-6 kez | 18,3 |
| 41-45 | 11,1 | 7-8 kez | 8,7 |
| 46 yaş ve üstü | 24,7 | 9'dan fazla | 8,1 |

İstatistik programında veri analizi sonucunda Cronbach Alpha değeri 0,956 (p değeri 0,001), Barlett testi sonucu 1267,750, toplam varyansı 0,61578, p 0,001 düzeyi ile Kaiser-Meyer-Olkin örneklem değeri 0,917 olduğu görülmüştür. Faktör analizi sonucunda faktör yükleri 0,40 üzerindeki dikkate alınmış, 502 ile 809 arasında faktör yükleri çıkmış ve 4 boyut belirlenmiş bu faktörler Tablo.2' de sunulmuştur.

Tablo 2. Faktör Analizi

| Faktörler | Faktör Yüğü | Öz değeri | Tanımlanan Faktör Yüğü | Alpha | Ortalama |
|--|-------------|-----------|------------------------|-------|----------|
| İşletme | | 6,698 | 21,611 | ,936 | 3,800 |
| Yorum sayısı | ,502 | | | | |
| Puan özeti | ,659 | | | | |
| Verdiği cevaplar | ,555 | | | | |
| Yorumların derecelendirilmesi | ,581 | | | | |
| Olumsuz yorumlar | ,725 | | | | |
| Tavsiye edilme oranı | ,715 | | | | |
| Olumlu yorumlar | ,789 | | | | |
| Beğenilme durumuna göre bölgedeki sırası | ,809 | | | | |
| Bölgedeki beğenilme oranı | ,797 | | | | |

| | | | | | |
|---|------|-------|--------|------|-------|
| Daha önce seyahat edenlerin puanı | ,796 | | | | |
| Ürün | | 4,938 | 15,931 | ,892 | 3,698 |
| Hizmet | ,688 | | | | |
| Fiyat | ,729 | | | | |
| Değer | ,697 | | | | |
| Kıyaslama | ,679 | | | | |
| Yeni ürünler | ,611 | | | | |
| Şikayetler | ,647 | | | | |
| Kullanıcı | | 4,452 | 14,361 | ,859 | 3,693 |
| Yorumların uzunluğu | ,547 | | | | |
| Demografik özellikler | ,607 | | | | |
| Grammer hataları | ,644 | | | | |
| Ülkeleri | ,711 | | | | |
| Tekrar gelme niyetleri | ,562 | | | | |
| Yorum yazma sıklıkları | ,797 | | | | |
| Daha önce yaptıkları yorum sayısı | ,727 | | | | |
| Diğer kullanıcılara faydalı olma sayısı | ,561 | | | | |
| Tatil | | 2,999 | 9,675 | ,830 | 3,614 |
| Yorumun geçtiği tatilin tarihi | ,560 | | | | |
| Tatile çıkma amacı | ,567 | | | | |
| Tatil süreci ile ilgili bilgi | ,528 | | | | |
| Tatil sürecindeki fotoğraflar | ,533 | | | | |
| Yorumların yazılma tarihi | ,614 | | | | |

Toplam Farkın Açıklanma Oranı= 0,61578 ve $p < 0,001$; Kaiser-Meyer-Olkin örneklem değeri =0,917

Birinci faktör on ifadeye sahip, tanımladığı fark yüzdesi 21,611'dir. Bu faktörü oluşturan ifadeler; "yorum sayısı"; "işletme puanlarının özeti"; "işletmenin yorumlara verdikleri cevaplar"; işletmeye ait yorumların derecelendirilmesi"; işletmeye ait olumsuz yorumlar"; işletmelerin tavsiye edilme oranı"; işletmeye ait olumlu yorumlar"; işletmenin beğenilme durumuna göre bölgedeki sırası ve oranı"; ve her bir kullanıcının işletmeye yönelik puanlamasıdır". İfadeler ele alındığında birinci faktörün, işletme ile ilgili ifadelerden oluştuğu anlaşılmaktadır.

İkinci faktör altı ifadeye sahip tanımladığı fark yüzdesi 15,931'dir. Bu faktörü oluşturan ifadeler; "hizmet hakkında yorumlar"; ürünlerin fiyatları hakkında yorumlar"; "ürünün değeri ile ilgili yorumlar"; "yorumlarda ürünlerin kıyaslanması"; "yeni ürünler" ve "ürünler hakkında şikâyetlerdir". İfadeler ele alındığında faktörün ürün ile ilgili ifadelerden oluştuğu anlaşılmaktadır.

Üçüncü faktör sekiz ifadeye sahip, tanımladığı fark yüzdesi 14,361'dir. Bu faktörü oluşturan

ifadeler; “Kullanıcıların yazdıkları yorumların uzunluğu”; demografik özellikler; “yazımlardaki gramer hatalarının özgürlüğü”; “Kullanıcıların ülkeleri”; “Tekrar gelme niyetleri”; “Kullanıcıların yorum yazma sıklıkları”; “Kullanıcıların daha önce yaptıkları yorum sayısı” ve “Kullanıcıların yaptıkların yorumların diğer kullanıcılara faydalı olma sayısıdır”. İfadeler ele alındığında faktörün kullanıcılar ile ilgili ifadelerden oluştuğu anlaşılmaktadır.

Dördüncü faktör beş ifadeye sahip tanımladığı fark yüzdesi 9,675’dir. Bu faktörü oluşturan ifadeler ; “Yorumun geçtiği tatilin tarihi”; “Tatile çıkma amacı”; “Tatil süreci ilgili bilgi”; Tatil sürecindeki fotoğraflar” ve “Yorumların yazılma tarihidir”. İfadeler ele alındığında faktörün tatil ile ilgili ifadelerden oluştuğu anlaşılmaktadır.

İşletme faktörünün ortalaması 3,800, ürün faktörünün ortalaması 3,698, kullanıcı faktörünün ortalaması 3,693 ve tatil faktörünün ortalaması 3,614’tür. Ziyaretçiler en yüksek ortalama işletme, en düşük ortalamayı tatil sürecine vermişlerdir .

Rezervasyon kararında ürün, kullanıcı, işletme ve tatil sürecinin etkisini belirlemek için yapılan regresyon analizinde, rezervasyon değişkeni ile ürün, kullanıcı, işletme ve tatil süreci değişkenleri arasındaki ilişki incelenmiş ve aşağıdaki tabloda sonuçlar sunulmuştur.

Table 3. Regresyon Analizi

| Variables | Beta | t | Sig t | VIF |
|------------------------------|---------------------|-------|-----------|-------|
| (Stables) | ,193 | ,666 | ,000 | |
| Ürün | ,766 | 7,662 | ,000 | 2,108 |
| Kullanıcı | ,400 | 4,613 | ,000 | 1,574 |
| İşletme | ,372 | 3,524 | ,000 | 2,795 |
| Tatil | ,346 | 3,418 | ,001 | 2,526 |
| Multiple Regression =,703 | R Square = ,495 | | p = ,001 | |
| Adjusted R Square = ,488 | Durbin-Watson=1,398 | | F =75,591 | |
| VIF=Variance Increase Factor | | | | |

Tablo.3’e göre rezervasyon sürecinde, ürün, kullanıcı, işletme ve tatil süreci değişkenlerinin önemli ölçüde etkilediği görülmüştür. Rezervasyonu en iyi açıklayan değişkenin ürün olduğu, sonra sırasıyla kullanıcı, işletme ve tatil sürecinin geldiği görülmektedir. Tabloda F değeri 75,591, p=,001 düzeyinde anlamlı olarak gerçekleştiği, çoklu Regresyon=,703 ve R Kare= 0,495’dir. Rezervasyon sürecini ürün, kullanıcı, işletme ve tatil süreci etkilemekte, sırasıyla ürün (b= ,766; t=7,662; p=,000), ikinci olarak kullanıcı geldiği (b= ,400; t=4,613; p=,000), üçüncü olarak işletme geldiği (b= ,372; t=3,524; p=,000) ve son olarak tatil süreci geldiği (b= ,346; t=3,418; p=,001) görülmektedir.

5.SONUÇ VE ÖNERİLER

Tüketicilerin zihninde bir farklılık yaratarak daha fazla rezervasyon almak isteyen otel yöneticilerin öncelikli olarak sırasıyla ürün, kullanıcı, işletme ve tatil süreci konularına eğilmeleri gerekmektedir. Özellikle ürün konusunda, ürün hakkında bilgi veren yorumlar, fiyatı, diğer ürünlerle kıyaslanması, yeni ürünlerle ilgili yorumların bulunması, ürünler hakkında şikâyetler, sorunlar ve tüketicilerin ödedikleri ücretin karşılığını aldıkları hakkında yorumlar rezervasyonu olumlu yönde arttıracığı görülmektedir. İşletme ile ilgili yorum sayısı, puan özeti, yorumlara verilen cevaplar, yorumların derecelendirilmesi, olumlu-olumsuz yorumlar, tavsiye edilme oranı, beğenilme durumuna göre bölgedeki sırası, oranı ve puanlamalar rezervasyonu etkilemektedir. Kullanıcıların yazdıkları yorumların uzunluğu, gramer hataları, kullanıcıların demografik bilgileri, ülkeleri, tekrar gelme niyetleri, yorum yazma sıklıkları, yazdıkları yorum sayısı ve kullanıcılara faydalı olma sayısı rezervasyonu etkilemektedir. Yorumların geçtiği tatilin tarihi, tatile çıkma amacı, tatil süreci ile ilgili bilgi, fotoğraflar ve yorumların yazılma tarihi rezervasyonu etkilemektedir. İleriki araştırmalarda tüketicilerinin yorumları ve bu yorumların otellere ait rezervasyon istatistikleri üzerinde etkileri değerlendirilebilir. Rezervasyon sitelerinde otele ait yorumlar ile o otele ait rezervasyon istatistikleri birlikte incelenmelidir.

KAYNAKÇA

- Ateş, A.,Kılınç, Ceyhan Ç., Sunar, H. (2016). “Analysing Online Customer Experience with Tripadvisor: The Case of Konya”, International Youth Science Forum “Litteris Et Artibus”, Lviv, Ukraine, 470-473.
- Aymankuy, Y., Soydaş, M.E. ve Saçlı, Ç. (2013) “Sosyal Medya Kullanımının Turistlerin Tatil Kararlarına Etkisi: Akademik Personel Üzerinde Bir Uygulama”, International Journal of Human Sciences, 10(1): 376-397.
- Cinnioğlu, H. ve Boz, M. (2015) “Sosyal Medya Araçlarından Facebook Sitesinin Otel İşletmeleri Açısından Kullanımının İncelenmesi: Çanakkale Örneği”, Akademik Bakış Dergisi, 51: 249-264.
- Cox, C., Burgess, S., Sellitto, C. ve Buultjens, J. (2009) “The Role of User-Generated Content in Tourists’ Travel Planning Behavior”, Journal of Hospitality Marketing & Management, 18:743–764.
- Çakıcı, A.C. ve Aksu, M. (2007) “Çekim Yeri Seçiminde Grup Etkisi: Yerli Turistler Üzerine Bir Araştırma”, Anatolia: Turizm Araştırmaları Dergisi, 18(2): 183-194.
- Demir, Ş.Ş. ve Kozak, M. (2011) “Turizmde Tüketici Davranışları Modelini Oluşturan Aşamalar Arasındaki İlişki”, Anatolia: Turizm Araştırmaları Dergisi, 22(1): 19-34.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Ergenekon Arslan, A. ve Güven, Ö.Z. (2018) “Turizm Sektöründe Elektronik Ağızdan Ağıza İletişimi Etkileyen Faktörlerin Demografik Özellikler Açısından İncelenmesi: Akademisyenler Üzerinde Bir Uygulama”, Dumlupınar Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, 57: 280-295.
- Erol, G. ve Hassan, A. (2014) “Gençlerin Sosyal Medya Kullanımı ve Sosyal Medya Kullanımının Tatil Tercihlerine Etkisi”, Journal of International Social Research, 7(31): 804-812.
- Eşitti, Ş. ve Işık, M. (2015) “Sosyal Medyanın Yabancı Turistlerin Türkiye’yi Tatil Destinasyonu Olarak Tercih Etmelerine Etkisi”, Karadeniz-Blacksea-Chornoye More, 27: 11-30.
- Nunnally, J. C. (1967) “Psychometric Theory”, New York: McGraw-Hill.
- Saçlı, Ç., Efe, D., Sunar, H. ve Ersöz, B. (2018) “Turizmde Online Müşteri Deneyimleri İle İtibar Yönetimi Arasındaki İlişki ve Örnek Uygulamalar”, 2. Uluslararası Turizmin Geleceği; İnovasyon, Girişimcilik ve Sürdürülebilirlik Kongresi, Mersin.
- Summak, Mehmet E., Sunar, H. ve Coşkun, M. (2017). Otel Seçiminde Online Müşteri Deneyimlerine Dayalı Analitik Hiyerarşi Süreci Yönteminin Kullanılması: Booking.Com Örneği, International Congress On Cultural Heritage And Tourism, Konya.
- Sunar, H., Gökçe, F., Cihangir, İ. S., Summak, E., Sürücü, A. S., (2018) “Tripadvisor Aracılığıyla Online Müşteri Deneyimlerinin İncelenmesi; Hatay Örneği”, VII. Doğu Akdeniz Turizm Sempozyumu, Hatay.
- Sü Eröz, S. ve Doğdubay, M. (2012) “Turistik Ürün Tercihinde Sosyal Medyanın Rolü ve Etik İlişkisi”, Dokuz Eylül Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 27(1): 133-157.
- Vural, Z.B.A. ve Bat, M. (2010) “Yeni Bir İletişim Ortamı Olarak Sosyal Medya: Ege Üniversitesi İletişim Fakültesine Yönelik Bir Araştırma”, Journal of Yaşar University, 20(5): 3348-3382.

FACTORS AFFECTING POVERTY: AN ANALYSIS FOR NUTS I REGIONS OF TURKEY

Aydanur GACENER ATIŞ*

Banu HAS**

ABSTRACT

In this study, the variables that affect poverty have been analyzed for NUTS I Regions of Turkey. In this context, poverty rate, unfair distribution of income ratio, fertility rate, net migration rate, non-directed loan rate, directed loan rate and secondary education schooling rate have been used in the study for period 2009-2016. According to the results obtained, unfair distribution of income rate and directed loan rate have increased poverty. On the other hand, fertility rate, net migration rate, non-directed loan rate and secondary education schooling rate have decreased poverty. According to the analysis of Granger Causality, a one-way causality relationship from unfair distribution of income rate, directed loan rate and secondary education schooling rate to poverty has been determined.

Key Words: *Poverty, Development, Panel Data Analysis*

Jel Codes: *I32, I38, C50*

1. INTRODUCTION

A general definition of poverty has become difficult due to regional development disparities and resource requirements. As a social risk, poverty is pushed to the back of society because individuals live below minimum living standards. This leads to a decline in the quality of life of individuals and prevents them from becoming productive society. At the same time, it becomes a social catastrophe that threatens society (Seyyar, 2002: 171). Inadequate nutrition, lack of access to clean water, inability to benefit from education and health services and lack of socio-cultural activities are the components of poverty.

Poverty is one of the most important social and economic problems in developed countries as in developing countries. Considering the income criterion in measuring the poverty rate leads to the discussion of this concept. Therefore, the United Nations' Human Development Index is considered a common and basic reference. The large differences between the GDP per capita of the countries with

* Assoc. Prof. Dr., Ege University, Faculty of Economics and Administrative Sciences, Department of Economics, İzmir, Turkey, aydanur.gacener@ege.edu.tr

** PhD Student, Ege University, The Graduate School of Social Sciences, Department of Economics, İzmir, Turkey, banuhasdeu@gmail.com

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

the same Human Development Index stem from the economic aspects of these indices as well as their social aspects (Demir, 2006: 4). Turkey's Human Development Index (HDI) value for 2015 is 0.767 -which put the country in the high human development category- positioning it at 71 out of 188 countries and territories. The 2016 Report places Turkey at 71st rank with 0.767 among 188 countries and territories (www.tr.undp.org).

Interregional ineffective resource allocation, spatial differences and development levels lead to a multidimensional concept of poverty. Therefore, factors that cause poverty are also very diverse. These factors include migration policies, repressive tax applications, unfair distribution of income, consumer credits and inefficient distribution of microcredit, lack of educational resources, lack of agricultural policies, lack of health and food services, and lack of social justice.

The concept of poverty has gained importance in conjunction with the World Development Report published by the World Bank. The concept of poverty is divided into sub-topics such as absolute poverty, relative poverty, human poverty, subjective-objective poverty, alternately poverty and working poverty throughout the world.

In our country, according to the the June 2018 report of Turkish Confederation of Labor Unions (Türk-İş), the hunger limit of a family of four was TL 1.714, the poverty threshold was TL 5.584. The hunger limit increased by 28 TL compared to the previous month of the same year and the poverty threshold increased by 92 TL. On the other hand, September 2018 Bulletin of Türk-İş, the hunger limit for a family of four was TL 1.893, while the poverty threshold was TL 6.167 calculated as. This situation indicates that the cost of living of a family of four has increased and the living conditions have become more difficult.

Table 1 shows that the the poverty rates calculated to the Poverty Rate by Equivalised Household Disposable Income in Turkey for 2006-2016.

In Table 1, the equivalent households considering 60% of the median disposable income ratio of the poverty rate of Turkish Statistical Institute (TSI) is taken into consideration. Accordingly, it tends to decrease poverty rates in Turkey. This rate was 25.4% in 2006, 21.9% in 2015, 21.2% in 2016 and 20.1% in 2017. Turkey, poverty ranking, is located in the middle row between European countries. The Czech Republic (9,7%) has the lowest share, followed by Finlands with 11.6% and Denmarks with 11.9% of inhabitants facing income poverty. It's the worst in Serbia with 25.5%, followed by Romania with 25.3% and Bulgaria with 22.9%.

Table 1. Poverty Rate by Equivalised Household Disposable Income, 2006-2017

| Years | Poverty Rate (%) |
|--------------|-------------------------|
| 2006 | 25,4 |
| 2007 | 23,4 |
| 2008 | 24,1 |
| 2009 | 24,3 |
| 2010 | 23,8 |
| 2011 | 22,9 |
| 2012 | 22,7 |
| 2013 | 22,4 |
| 2014 | 21,8 |
| 2015 | 21,9 |
| 2016 | 21,2 |
| 2017 | 20,1 |

Source: TSI

In this respect, the variables that affect poverty have been analyzed for NUTS I Regions of Turkey. First of all, the literature on the subject was discussed, then data sets and methods were introduced, and the results of the application and the findings were evaluated.

2. LITERATURE

There are many studies in the literature that analyze the variables for determining the poverty rate. In this section, the literature which takes into account the variables used in this study is searched and the related studies are given below.

Aktan and Vural (2002a) examined the effects of macroeconomic instruments on poverty. If interest rates are reduced and credit opportunities are increased, the income of poor individuals increases. Therefore, poverty may decrease. The subsidies given to reduce poverty create distortions in the market and disrupt the income distribution. This causes interregional development disparities and increases poverty.

Aktan and Vural (2002) have developed recommendations to reduce poverty. In this context, they recommended reducing the credit subsidies that led to public intervention and deviations in the markets.

Afsar (2003) investigated the relationship between rural-urban migration and poverty. In the literature, the findings obtained from the migration studies in Bangladesh were evaluated. Migration has been found to be effective in reducing rural poverty. Health problems and other problems of migrants should be considered. At the same time, he concluded that internal migration had direct and indirect positive effects on poverty reduction and regional development.

Social Investments Commission (2008) examined the potential advantages and disadvantages of consumer loans for poor people. If poor individuals benefit from consumer credit facilities, their

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

productive activities are increasing and they are moving away from the poverty line. He predicted that the negative effects of micro credit and consumer loans could be eliminated through risk management.

Awan et al. (2011) analyzed the relationship between education and poverty. The level of education and poverty in Pakistan between 1998-99 and 2001-02 was analyzed by logistic regression method. According to research findings, poverty decreases as education level increases.

Bayaner (2012) discussed the impact of agricultural credit practices on the economy. Agricultural credit practices reduce poverty and subsidized loans provide agricultural development. In addition, the negativity of subsidized agricultural loans in the price system and the imbalances of government intervention in the market have been discussed..

Bakırtaş and Kandemir (2012) examined the effect of variables on education index on poverty. population ratio of the number of individuals having a green card in 2010 in Turkey, the proportion of illiterate and have picked up rate in primary education enrollment rate of the population. In the study using regression analysis, the education indicators in the model have a statistically significant effect on poverty and have demonstrated the importance of human capital education expenditures in the fight against poverty.

Awuse and Offin (2013) examined the effects of internal migration on poverty reduction in Ghana. In Ghana, 800 participants were interviewed in 7 regions and stated that internal migration reduced poverty. They suggested that policy makers should ease migrants' workloads, improve work environments, and increase resources in the long run.

Erkal et al. (2015) determined the relationship between poverty and income inequality in Eastern Europe and Latin America countries between 1998 and 2010. Unbalanced panel data analysis method was used in the study. According to the results of the analysis, the 1 unit increase in Gini coefficient increased the poverty rate by 0.699 units.

Yar (2015) investigated the relationship between income distribution inequality and poverty between 2002-2010. At the same time, since 1987, it has examined the trend of income distribution in Turkey. According to the findings, inequality of income distribution increases poverty.

Şentürk (2016) discussed family benefits and recommended the promotion of fertility. thus, the dynamic population will increase and the negative effects of the elderly population on the economy will be eliminated and poverty will be reduced. To achieve this, family insurance models need to be developed. these models include the promotion of having children in poor families and the collection of family benefits in a single center.

3. DATA SET, METHODS and FINDINGS

3.1. Data Set and Model

In this study, the variables that affect poverty have been evaluated with balanced panel data analysis for NUTS I Regions of Turkey for the period 2009-2016. In the linear model, the poverty rate of 12 sub-regions, which were calculated as 60% of the median income, were used as dependent variables. The independent variables of the model are the P80 / P20 ratio, fertility rate, net migration rate ratio, non-specialized credit ratio, specialized credit ratio and secondary education schooling rate. Credit data from the Banks Association of Turkey, the other variables are taken from the TUIK data. EViews and Gretl were used in the analysis. The functional representation of the model is as follows;

$$Yoksul = f(esitsiz, kredi1, dogoran, gocoran, kredi2, okuloran) \tag{1}$$

$$Yoksul_{it} = \beta_{0it} + \beta_{1it} esitsiz_{it} + \beta_{2it} kredi1_{it} + \beta_{3it} dogoran_{it} + \beta_{4it} gocoran_{it} + \beta_{5it} kredi2_{it} + \beta_{6it} okuloran_{it} + \varepsilon_{it} \tag{2}$$

The variables and explanations of the model are as follows;

yoksul: poverty rate calculated according to 60% of median income

esitsiz: P80 / P20 ratio representing unfair distribution of income ratio

kredi1: non-directed loan rate, mainly composed of consumer loans

dogoran: fertility rate

gocoran: net migration rate ratio

kredi2: directed loan rate, the majority of which are agricultural loans

okuloran: secondary education schooling rate as indicator of education

3.2. Method

In the study, balanced panel data analysis was used because the data were complete. There are two types of approach in regressions with panel data. These are: Fixed Effects Model (FEM) and Random Effects Model (REM).

3.2.1. Fixed Effects Model

The model of fixed effects is based on the assumption that c_i is associated with the excluded variables.

$$E [c_i | X_i] = h (X_i) \tag{3}$$

It is assumed that the conditional average of each period is the same.

$$Y_t = x'_{it} \beta + h (X_i) + \varepsilon_{it} + [c_i - h (X_i)] = x'_{it} \beta + \alpha_{it} + \varepsilon_{it} + [c_i - h (X_i)] \tag{4}$$

$$Y_{it} = x'_{it} \beta + \alpha_i + \varepsilon_{it} \tag{5}$$

(Greene, 2016: 360-361).

3.2.2. Random Effects Model

If singular effects are completely unrelated to explanatory variables, we can assume that certain singular fixed terms are randomly distributed between horizontal sections.

$$Y_{it} = x'_{it} \beta + (\alpha + u_i) + \varepsilon_{it} \tag{6}$$

u, "i." observation is very heterogeneous and does not change over time.

$$E[\varepsilon_{it} | X] = E[u_i | X] = 0, \tag{7}$$

$$E[\varepsilon_{it}^2 | X] = \sigma^2_{\varepsilon} \tag{8}$$

$$E[u_i^2 | X] = \sigma^2_u, \tag{9}$$

$$E[\varepsilon_{it} u_j | X] = 0 \quad \text{tüm } i, t \text{ ve } j \text{'ler} \tag{10}$$

$$E[\varepsilon_{it} \varepsilon_{js} | X] = 0 \quad t \neq s \text{ veya } i \neq j \tag{11}$$

$$E[u_i u_j | X] = 0 \quad i \neq j \tag{12}$$

we can show the following example of the T observation for i:

$$n_{it} = \varepsilon_{it} + u_i \tag{13}$$

$$n_i = [\eta_{i1}, \eta_{i2}, \dots, \eta_{iT}] \tag{14}$$

η_{it} , reveals the model of error components. Therefore,

$$E[\eta_{it}^2 | X] = \sigma^2_{\varepsilon} + \sigma^2_u, \tag{15}$$

$$E[\eta_{it} \eta_{js} | X] = \sigma^2_u, \quad t \neq s \tag{16}$$

$$E[\eta_{it} \eta_{js} | X] = 0 \quad i \neq j \text{ for all } t \text{ and } s \tag{17}$$

For the T observation of the unit i, take $\sum [\eta_i \eta'_i | X]$. Accordingly, because the observations i and j are independent of each other, the common variance matrix for all nxT observations is as follows;

$$\Omega = \begin{bmatrix} \sum & 0 & \dots & 0 \\ 0 & \sum & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & \sum \end{bmatrix} = I_n \otimes \Sigma$$

the term η_{it} which means composite error, consists of horizontal section error component ε_{it} and time series and horizontal section error component u_{it} . In the error component model, the compound error term is correlated with variables in the model (Greene, 2016:371-372).

3.3. Findings

First of all, whether the variables are stable or not, were examined by Levin, Lin&Chu and Fisher Phillips Perron unit root tests and the results were shown in Table 2. In Table 2, variables are stationary in the level values. Therefore, the probability of spurious regression is zero. Table 3 shows that the results of ordinary least squares (OLS) and interpreted the significance and explanation power of the model.

Table 2. Unit Root Test Results

| Variables | Levin, Lin&Chu | | PP-Fisher | |
|-------------------------------------|----------------|--------|-----------|--------|
| | Statistic | Prob** | Stat | Prob** |
| Poverty Ratio | -13.7038 | 0.000 | 140.411 | 0.000 |
| Unfair distribution of income ratio | -8.14246 | 0.000 | 121.915 | 0.000 |
| Non-directed Loan Ratio | -5.82668 | 0.000 | 90.0117 | 0.000 |
| Rate of Birth | -6.53930 | 0.000 | 86.8491 | 0.000 |
| Net Migration Rate | -10.8615 | 0.000 | 151.339 | 0.000 |
| Directed Loan Rate | -7.37168 | 0.000 | 76.0187 | 0.000 |
| Secondary education schooling rate | -6.81330 | 0.000 | 67.8761 | 0.000 |

** Fisher's test, which is calculated for its probabilities, shows asymptotic chi-square distribution. Levin, Lin & Chu unit root test is based on the assumption of asymptotic normality. Spectral Kernel Quadratic Form conversion.

Independent variables explain the dependent variable (poverty rate) by 53%. According to the "F" test prob, the model is statistically significant since it is $0.000 < 0.05$. If the unfair distribution of income ratio increases by 1 unit, the poverty rate increases by 0.71 unit. The income gap between the first quintile (20%) and the last quintile (20%) is increased, so poverty rate is increased, too. If the use of non-directed loans increases by 1 unit, the poverty rate is reduced by 0.04. If the birth rate increases by 1 unit, poverty rate decreases by 0.030 unit.

Table 3. Balanced Panel OLS Results

| Dependent Variable:YOKSUL | | | | |
|---------------------------|-------------|-----------------------|-------------|----------|
| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Statistic | Prob. |
| ESITSIZ | 0.713671 | 0.182532 | 3.909836 | 0.0002 |
| KREDI1 | -0.040677 | 0.016025 | -2.538366 | 0.0129 |
| DOGORAN | -0.030096 | 0.013688 | -2.198738 | 0.0305 |
| GOCORAN | -0.061168 | 0.027073 | -2.259402 | 0.0263 |
| KREDI2 | 2.189058 | 0.622565 | 3.516195 | 0.0007 |
| OKULORAN | -0.080227 | 0.023017 | -3.485547 | 0.0008 |
| C | 21.83500 | 2.860541 | 7.633173 | 0.0000 |
| R-squared | 0.530801 | Mean dependent var | | 19.00521 |
| Adjusted R-squared | 0.499170 | S.D. dependent var | | 2.028604 |
| S.E. of regression | 1.435631 | Akaike info criterion | | 3.631207 |
| Sum squared resid | 183.4321 | Schwarz criterion | | 3.818191 |
| Log likelihood | -167.2979 | Hannan-Quinn criter. | | 3.706789 |
| F-statistic | 16.78083 | Durbin-Watson stat | | 1.605256 |
| Prob(F-statistic) | 0.000000 | | | |

Most non-directed loans consist of consumer loans. The increase in these loans ensures that the basic needs of the poor are met. On the other hand, diversification of policies for family allowance in our country has reduced the cost of the elderly population on the economy by encouraging fertility. With the increase in family allowance children of poor households are raised in a healthier environment.

If the net migration rate increases by 1 unit, the poverty rate decreases by 0.06 units. If the use of specialized credit increases by 1 unit, the poverty rate increases by 2.18 units. Internal migration, with its flexible employment opportunities, has an impact on poverty reduction. Besides, agricultural loans

have the largest share in directed loans. In agricultural loan applications, there are deviations in the market due to the state intervention (Bayaner, 2012). In addition, government subsidies cause imbalances in price mechanism and disrupt resource allocation. In addition, the negative effect on income and wealth distribution increases interregional development differences and poverty rate (Aktan and Vural, 2002a). If secondary education schooling rate increases by 1 unit, the poverty rate decreases by 0.08 units. the increase in education opportunities has had a poverty reduction effect.

Table 4. Variance Multipliers of Independent Variables

| | | | |
|--|-------|----------|-------|
| Minimum value = 1.0 | | | |
| Values greater than 10.0 may indicate a multicollinearity problem. | | | |
| esitsiz | 1,606 | kredi1 | 1,224 |
| dogoran | 3,504 | gocoran | 2,061 |
| kredi1 | 1,322 | okuloran | 3,768 |

The existence of multicollinearity problem between variables is examined in Table 4. According to the results obtained from Table 4, each of the independent variables was below the variance multipliers factor of 10. Thus, no multicollinearity problem were found between the independent variables.

The JB test was used to determine whether the residues of the model are normally distributed. Accordingly, as the prob value was $0.516 > 0.05$, it was concluded that the residues were distributed normally. On the other hand, the presence of different variance (heteroscedasticity) in the residues is investigated in Table 5.

Table 5. LR Test Heteroscedasticity Results

| | Value | df | Probability |
|-------------------|-----------|----|-------------|
| Likelihood ratio | 15.25952 | 12 | 0.2275 |
| LR test summary: | | | |
| | Value | df | |
| Restricted LogL | -167.2979 | 89 | |
| Unrestricted LogL | -159.6682 | 89 | |

According to Table 5, there is no different variance in residuals. Because, the prob value (0.2275) is bigger than 0.05. On the other hand, according to the Breusch Pagan test result (Breusch Pagan LM = 13, 4862 with p-value = prob (chi-square (1) > 13, 4862) = 0.000240329), Hausman test was applied. Table 6 shows the results of this test.

Table 6. Hausman Test Results

Correlated Random Effects - Hausman Test
Equation: Untitled
Test period random effects

| Test Summary | Chi-Sq. Statistic | Chi-Sq. d.f. | Prob. |
|---------------|-------------------|--------------|--------|
| Period random | 1.268629 | 6 | 0.9734 |

According to the results from Table 6, if the prob value is bigger than 0.05, the specification of the model is correct and the model of random effects is valid. On the other hand, Panel EGLS Coincident Effects Model results are given in Table 7.

In Table 7, variables are statistically significant. Independent variables explain the dependent variable (poverty rate) by 53%. According to the value of F prob, the model is statistically significant. The results are also compatible with the OLS method. If the unfair distribution of income ratio increases by 1 unit, the poverty rate increases by 0.73 units; if the directed loan rate increases by 1 unit, the poverty rate increases by 2.24 units. In addition, if non-directed loans increase by 1 unit, poverty decreases by 0.04 units; if birth rate increases by 1 unit, poverty decreases by 0.02 units and net migration rate decreases by 1 unit, poverty rate decreases by 0.06 units. Finally, if the rate of secondary education schooling rate increases by 1 unit, the rate of poverty decreases by 0.07 units.

Table 7. Panel EGLS Random Effects Model Test Results

| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Statistic | Prob. |
|-----------------------|-------------|--------------------|-------------|--------|
| ESITSIZ | 0.734874 | 0.189237 | 3.883350 | 0.0002 |
| KREDI1 | -0.041561 | 0.016286 | -2.551868 | 0.0124 |
| DOGORAN | -0.029487 | 0.016297 | -1.809298 | 0.0738 |
| GOCORAN | -0.060775 | 0.028048 | -2.166823 | 0.0329 |
| KREDI2 | 2.241445 | 0.633676 | 3.537211 | 0.0006 |
| OKULORAN | -0.078862 | 0.030664 | -2.571783 | 0.0118 |
| C | 21.53868 | 3.606341 | 5.972449 | 0.0000 |
| Effects Specification | | | | |
| | | | S.D. | Rho |
| Period random | | | 0.463888 | 0.0926 |
| Idiosyncratic random | | | 1.452170 | 0.9074 |
| Weighted Statistics | | | | |
| R-squared | 0.507243 | Mean dependent var | 12.74244 | |
| Adjusted R-squared | 0.474023 | S.D. dependent var | 1.948373 | |
| S.E. of regression | 1.413043 | Sum squared resid | 177.7055 | |
| F-statistic | 15.26939 | Durbin-Watson stat | 1.567232 | |
| Prob(F-statistic) | 0.000000 | | | |
| Unweighted Statistics | | | | |
| R-squared | 0.530630 | Mean dependent var | 19.00521 | |
| Sum squared resid | 183.4989 | Durbin-Watson stat | 1.621529 | |

The results of the Granger causality test are shown in Table 8. the results of the Granger causality test are shown in Table 8. In Table 8, according to Granger causality test results, there was a one-way causality relationship between unfair distribution of income ratio, the rate of use of directed loans and

the secondary education schooling rate to poverty. According to this, unfair distribution of income ratio, the rate of use of directed loans and the rate of secondary education schooling rate are the Granger causes of poverty, and these variables can explain the changes in poverty rate. In addition, there is a one-way causality relationship between poverty and non-specialised credit utilization rates and fertility rate. There was no causal relationship between net migration rate and poverty.

Table 8. Granger Causality Test Results

| Lag Length:2 | F Statistic | Prob |
|---|-------------|--------|
| <i>GELIR does not Granger Cause YOKSUL</i> | 5.7278 | 0.0051 |
| <i>YOKSUL does not Granger Cause GELIR</i> | 0.8314 | 0.4398 |
| <i>KREDI1 does not Granger Cause YOKSUL</i> | 0.1719 | 0.8424 |
| <i>YOKSUL does not Granger Cause KREDI1</i> | 4.6204 | 0.0132 |
| <i>DOGORAN does not Granger Cause YOKSUL</i> | 1.9905 | 0.1446 |
| <i>YOKSUL does not Granger Cause DOGORAN</i> | 3.6918 | 0.0301 |
| <i>GOCORAN does not Granger Cause YOKSUL</i> | 1.6843 | 0.1933 |
| <i>YOKSUL does not Granger Cause GOCORAN</i> | 1.3600 | 0.2636 |
| <i>KREDI2 does not Granger Cause YOKSUL</i> | 2.9245 | 0.0621 |
| <i>YOKSUL does not Granger Cause KREDI2</i> | 0.2597 | 0.7722 |
| <i>OKULORAN does not Granger Cause YOKSUL</i> | 2.4945 | 0.0902 |
| <i>YOKSUL does not Granger Cause OKULORAN</i> | 0.3781 | 0.6866 |

4. CONCLUSIONS

Poverty is one of the most important problems of developing countries. The problem is not only economic but also a social problem.

In this study, a panel data analysis was carried out using poverty rate, unfair distribution of income ratio, fertility rate, net migration rate, non-directed loan rate, directed loan rate and secondary education schooling rate for NUTS I Regions of Turkey. The analysis revealed that the unfair distribution of income ratio and the ratio of directed loans increased poverty rate and the ratio of non-directed loan rate, fertility rate, net migration rate and secondary education schooling rate decreased poverty. At the same time, there has been a one-way causation of poverty from the ratio of income distribution inequality, the ratio of specialised loans and the ratio of secondary education schooling. There is a one-way causality relationship from poverty to non-specialized credit ratios and fertility.

According to the empirical results, we can list the political proposals as follows:

Providing justice of taxation, placing high tax rates on the wealthy helps to redistribute income throughout society, contributing to the formation of qualified human capital by emphasizing welfare, health and education investments, increasing the effectiveness of subsidies for the agricultural sector, increasing the use of non-specialized loans, mostly consumer loans, and-to increase the productive and dynamic population by developing family assistance models.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Increasing opportunities for flexible employment. Therefore, working conditions of migrants should be improved.

Increasing the quality of education. Since the secondary education schooling rate leads to poverty reduction, the balanced distribution of educational resources among the regions will reduce the developmental differences in the regions.

Policies for the development of family allowance models should be developed.

REFERENCES

- Afsar, Rita, (2003). “Internal Migration and the Development Nexus:The Case of Bangladesh”, www.migrationdrc.org/publications/working.../WP-C2.pdf, Erişim tarihi:15.07.2018
- Aktan, Coşkun Can ve Vural, İstiklal Yaşar, (2002) “Yoksullukla Mücadeleye İlişkin Öneriler”, Coşkun Can Aktan (ed.), Yoksullukla Mücadele Stratejileri, Ankara: Hak-İş Konfederasyonu Yayınları.
- Aktan, Coşkun Can ve Vural, İstiklal Yaşar, (2002a). “Makro- Ekonomik Politikalar, Gelir Dağılımı ve Yoksulluk”, Coşkun Can Aktan (ed.), Yoksullukla Mücadele Stratejileri, Ankara: Hak-İş Konfederasyonu Yayınları.
- Awan, Masood; Malik, Nouman; Sarwar, Haroon and Waqas, Muhammad, (2011). “Impact of Education on Poverty Reduction”, *International Journal of Academic Research*, 3 (1): 659-664.
- Awuse, Nicholas and Tandoh-Offin, Patrick, (2013). “International Migration and Poverty Reduction in Ghana”, *Journal of Economics and Sustainable Development*, 4(18): 63-70.
- Bakırtaş, Tahsin ve Kandemir, Orhan, (2012). “Türkiye’de Yetersiz Eğitim ve Yoksulluk İlişkisi: İller Bazında Ekonometrik Bir Analiz”, *İstanbul Finans Kongresi*, 1-19.
- Bayaner, Ahmet, (2012). “Türkiye’de Tarımsal Kredi Politikaları ve Tarım Kredi Kooperatifleri”, *Üçüncü Sektör Sosyal Ekonomi*, 47 (1): 69-84.
- Demir, Sırma, (2006). “Birleşmiş Milletler Kalkınma Programı İnsani Gelişme Endeksi ve Türkiye Açısından Değerlendirme”, *DPT Sosyal Sektörler ve Koordinasyon Genel Müdürlüğü*, Ankara, 2-5.
- Erkal, Gökhan; Akıncı, Merter ve Yılmaz, Ömer, (2015), “Yoksulluk, Gelir Eşitsizliği ve Ekonomik Büyüme İlişkisi: Seçilmiş Doğu Avrupa ve Latin Amerika Ülkeleri İçin Ampirik Bir Analiz”, *TISK Akademi*, 10 (19): 66-87.
- Greene, William H., (2016). “Ekonometrik Çözümleme”, *Palme Yayıncılık*, 7. Baskı, 360-371.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Mill, Alfred, (2018). “Ekonomi 101”, Say Yayınları, 3. Baskı, İstanbul.

Seyyar, Ali, (2002). “Sosyal Siyaset Terimleri”, Beta Yayınları, İstanbul.

Social Investments Comission, (2008). “Consumer Credits for the Poor-Risk or Opportunity?”, <https://www.microfinancegateway.org/sites/default/files/mfg-en-paper-consumer-credits-for-the-poor-risk-or-opportunity-2008.pdf>, Erişim tarihi: 16.07.2018.

Şentürk, Ferhat, (2016). “Türkiye İçin Bir Aile Sigortası Model Önerisi”, Sosyal Güvence Dergisi, 5 (9): 102-139.

Türk-İş, (2018). “Türkiye İşçi Sendikaları Konfederasyonu Haber Bülteni”, Haziran.

Türk-İş, (2018). “Türkiye İşçi Sendikaları Konfederasyonu Haber Bülteni,” Eylül.

Yar, Fatih, (2015). “Türkiye’de Gelir Dağılımı ve Yoksulluk”, Global Analiz-Toplum ve Ekonomi Çalışmaları Merkezi.



**TÜRKİYE' DE KOBİLER VE İHRACATA KATKILARI İÇİN KOBİLERE YAPILAN
DEVLET DESTEKLERİ**

Doç. Dr. Burak ÇAMURDAN*

ÖZET

Ülkenin ekonomik ve sosyal ihtiyaçlarının karşılanmasında küçük ve orta ölçekli işletmelerin payını ve etkinliğini daha da artırmak, rekabet güçlerini ve düzeylerini yükseltmek, sanayide entegrasyonu ekonomik gelişmelere uygun biçimde gerçekleştirmek amacıyla, 1990 yılında, 3624 sayılı yasa ile Küçük ve Orta Ölçekli İşletmeleri Geliştirme ve Destekleme İdaresi Başkanlığı (KOSGEB) kurulmuştur. KOBİler özellikle girişimcilikte, imalat sanayinde, istihdama katkıda, iç ve dış ticarete ülke ekonomisinde çok önemli rol oynamaktadır. 24.06.2018 tarihli Resmi Gazete' de 2018/11828 Karar yayımlanarak yürürlüğe giren, "Küçük ve Orta Büyüklükteki İşletmelerin Tanımı, Nitelikleri ve Sınıflandırılması Hakkında Yönetmelik" değişikliği ile de KOBİ tanımı günümüz gerekliliklerine uygun hale getirilmek üzere revize edilmiştir. KOBİler bu yeni düzenlemeye göre: 1- Çalışan Personel Sayısı, 2- Yıllık Net Satış Hâsılatı, 3- Yıllık Mali Bilanço Toplamı kriterlerine bağlı olarak sınıflandırılmaktadır. Bu bağlamda KOBİler Türkiye' de 1-Mikro Ölçekli, 2-Küçük Ölçekli ve 3-Orta Ölçekli olmak üzere kategorize edilmişlerdir. KOBİler bu rollerine paralel olarak devletçe önemli ölçüde desteklenmektedirler. Destekler aynı zamanda diğer motivatörleri de kapsıyor olmasına karşın motivatörler destekler başlığı dışında, teşvikler tanımlamasıyla istatistiksel veri olarak ayrıca derlenmektedir. Bu istatistiksel verilerin analizi sonucu KOBİlerin gelişme süreçleri boyunca dış ticarete, özellikle ihracatta yüksek oranlı pay aldıkları görülmektedir. Ancak, 2012 yılını takiben ihracattaki paylarının azalma eğilimine girdiği belirlenmiştir. Bu çalışmada bu azalma eğiliminde devlet desteklerinin bir fonksiyonu olup olmadığı araştırılarak devlet destekleri-teşvik uygulaması etkisi ile ilgili bulgulara ve önerilere yer verilmektedir.

Anahtar Kelimeler: Kobi Sınıflaması, KOBİler için Devlet Destekleri-Teşvikler, İhracat, KOSGEB, Kobi İstatistikleri,

Jel kodu: P33, P45, F13, M13

* Pamukkale Üniversitesi, Honaz Meslek Yüksekokulu, Bankacılık ve Sigortacılık Bölümü, Menkul Kıymetler ve Sermaye Piyasaları Programı, Denizli-Türkiye, E-posta: bcamurdan@pau.edu.tr, Orcid No:0000-0002-4342-2946

**THE SMES IN TURKEY AND THE STATE INCENTIVES GIVEN FOR THEIR
CONTRIBUTIONS TO EXPORTS**

ABSTRACT

In order to increase the share and efficiency of small and medium-sized enterprises in the country's economic and social needs, to increase the competitiveness and levels, to realize the integration in industry in accordance with the economic developments, (KOSGEB) was established. SMEs play an important role in the economy of the country, especially in entrepreneurship, manufacturing industry, contributing to employment, domestic and foreign trade. In the Official Gazette dated 24.06.2018 2018/11828, the 'Regulation on the Definition, Qualifications and Classification of Small and Medium-sized Enterprises, which came into force after being published, was revised to bring the SME definition into compliance with the requirements of today.

According to this new regulation, SMEs are classified according to the criteria of 1- Employee Employees, 2-Year Net Sales Income and 3-Year Financial Balance Sheet Total. In this context, SMEs in Turkey Micro-Sized 1, 2 and 3-Medium-Small Sized were categorized to be. SMEs are supported by the state in parallel to these roles. Supports are also compiled as statistical data with the definition of incentives except for the support of motivators although they also include other motivators. As a result of the analysis of these statistical data, it is seen that SMEs take a high share in foreign trade, especially in exports during the development process. However, it is determined that the shares in exports following 2012 tend to decrease. In this study, it is searched whether there is a function of state subsidies in this decreasing tendency and findings and suggestions related to the effect of state support-incentive application are included.

Key Words: *SME Classification, State Supports for SMEs-Incentives, Exports, KOSGEB, SME Statistics*
Jel Kodu: *P33, P45, F13, M13*

1.GİRİŞ

Hemen hemen her ülkede küçük ve orta boy işletmeler ekonomik yapının temelini teşkil etmelerine rağmen, aslında yetenekli oldukları halde ve pek çok bürokratik engel nedeniyle, ölçeklerini büyütmezler. Gerek ülkemizde, gerekse dünya ekonomilerinde Küçük ve Orta Büyüklükteki İşletmeler (KOBİ'ler) yaşanan önemli krizlerden fazlaca etkilenmemiş ve hatta bu krizlerin atlatılmasında da önemli roller üstlenmişlerdir.

KOBİ'ler sadece az gelişmiş ve gelişmekte olan ülkelerde değil aynı zamanda ekonomik olarak gelişmiş ülkelerde de yaygın olarak önemli roller üstlenmektedirler. Sayıları, istihdam imkânları ve

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

katma değer gibi önemli ekonomik konular bakımından karşılaştırıldığında gelişmiş ekonomilerde de KOBİ'ler önemli konumlara sahiptirler (Ar, A.A. ve İskender, H. 2015).

Küçük ve orta ölçekli işletmelerin ekonomik ve sosyal açıdan taşıdıkları önem, ülkeleri ve araştırmacıları bu işletmelerin sorunlarını gidermeye ve bu işletmelerden daha yüksek verim elde etmek yoluyla ülke ekonomisini güçlendirmeye yöneltmiştir. Türkiye'de ve dünyada çeşitli KOBİ tanımları yapılmaktadır. KOBİ tanımı ülkeden ülkeye değişebilmektedir ancak bazı kriterler bakımından da benzerlikler gösterebilmektedir. Bu kriterler: Nitel ve Nicel olmak üzere temelde 2 grupta ele alınmaktadır. Bunlar:

A-Nitel kriterler:

İşletmenin faaliyet gösterdiği iş kolu içerisinde nispeten küçük bir paya sahip olması,
İşletme sermayesinin tümünün veya büyük bir bölümünün, işletme sahibine ait olması,
İş bölümü ve uzmanlaşma derecesi,
Girişimcinin işletmede fiilen çalışması,
Bağımsız yönetim (genelde işletmenin sahibi aynı zamanda yöneticisidir),
Modern yönetim tekniklerini uygulamada yetersizlik

B-Nicel kriterler:

Personel Sayısı,
Sermaye Yapısı ve Hacmi,
Üretim Miktarı,
Aktifler Toplamı,
Makine Parkı,
Pazar Payı,
Karlılık Rasyoları,
Kullandıkları Enerji Miktarı,
Yıllık Net Satış Hasılatı,
Yıllık Net Mali Bilanço Toplamı

Türkiye' de Küçük ve Orta Büyüklükteki İşletmelerin tanımı, nitelikleri ve sınıflandırılması 24.06.2018 tarihli Resmi Gazete' de yayımlanarak yürürlüğe giren, 2018/11828 Karar ile revize edilerek yenilenmiştir. Bu karara bağlı yönetmelik ile KOBİ tanımı günümüz gerekliliklerine uygun hale getirilerek, KOBİ'ler:

Çalışan Personel Sayısı,
Yıllık Net Satış Hâsılatı,
Yıllık Mali Bilanço Toplamı temellerinde sınıflandırılmaktadır.
Yeni sınıflandırma çerçevesinde KOBİ'ler Türkiye' de;

Mikro Ölçekli,

Küçük Ölçekli,

Orta Ölçekli olmak üzere kategorize edilmişlerdir²¹.

Bakanlar Kurulu Kararı uyarınca:

a) **Mikro işletme:** On kişiden az yıllık çalışan istihdam eden ve yıllık net satış hasılatı veya mali bilançosundan herhangi biri bir milyon Türk Lirasını aşmayan işletmeler.

b) **Küçük işletme:** Elli kişiden az yıllık çalışan istihdam eden ve yıllık net satış hasılatı veya mali bilançosundan herhangi biri sekiz milyon Türk Lirasını aşmayan işletmeler.

c) **Orta büyüklükteki işletme:** 250 kişiden az yıllık çalışan istihdam eden ve yıllık net satış hasılatı veya mali bilançosundan herhangi biri kırk milyon Türk Lirasını aşmayan işletmeler.” olarak tanımlanmıştır.

Tablo 1. Türkiye’de KOBİ Sınıflandırılma Kriterleri

| Kriter | Mikro Ölçekli Kobi | Küçük Ölçekli Kobi | Orta Ölçekli Kobi |
|-----------------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| Çalışan Personel Sayısı | <10 | <50 | <250 |
| Yıllık Net Satış Hasılatı | ≤ 3 Milyon TL | ≤ 25 Milyon TL | ≤ 125 Milyon TL |
| Yıllık Mali Bilanço Toplamı | ≤ 3 Milyon TL | ≤ 25 Milyon TL | ≤ 125 Milyon TL |

Kaynak: TOBB - KOBİ Araştırma ve Danışmanlık Merkezi Müdürlüğü

Avrupa Birliği’nde 1 Ocak 2005’te yürürlüğe giren KOBİ tanımı, 2003/361/EC sayılı tüzük çerçevesinde, Türkiye’de olduğu gibi, çalışan kişi sayısı, yıllık ciroları veya bilanço büyüklüğü ve (son olarak bağımsızlık unsuru da değerlendirmeye alınmaya başlanmıştır) ölçütlerini kapsamaktadır. Buna göre:

Tablo 2. AB’ de KOBİ Sınıflandırılma Kısıtları

| Kriter | Mikro Ölçekli Kobi | Küçük Ölçekli Kobi | Orta Ölçekli Kobi |
|-----------------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| Çalışan Personel Sayısı | <10 | <50 | <250 |
| Yıllık Net Satış Hasılatı | ≤ 2 Milyon Avro | ≤ 10 Milyon Avro | ≤ 50 Milyon Avro |
| Yıllık Mali Bilanço Toplamı | ≤ 2 Milyon Avro | ≤ 10 Milyon Avro | ≤ 43 Milyon Avro |

Kaynak: TOBB - KOBİ Araştırma ve Danışmanlık Merkezi Müdürlüğü ve KOSGEB

Yine yukarıda bahsedilen, 2018/11828 Kararda yer alan bir başka değişiklik uyarınca (bkz. 7. Madde) bir işletme;

²¹ 04/11/2012 Tarihli, 28457 Sayılı Resmi Gazete’ de yayınlanarak yürürlüğe giren, 10/9/2012 Tarihli ve 2012/3834 Sayılı kararın 4. Maddesi uyarınca Bakanlar Kurulu’na belirlenmiştir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- a) Başka bir işletmenin sermaye veya oy haklarının çoğunluğuna sahip olma,
- b) Başka bir işletmenin yönetim, yürütme veya denetim kurulu üyelerinin çoğunluğunu atama veya azletme yetkisine sahip olma,
- c) Başka bir işletmenin hissedarı veya ortağı olup, bu işletmenin diğer hissedarları veya ortaklarıyla yaptığı anlaşma ile bunların oy haklarının çoğunluğunu tek başına kontrol etme hakkına sahip olma, şartlarından en az birini taşıması halinde bu işletmelerden birincisi hâkim, diğeri ise bağlı işletme olarak tanımlanmıştır. Karara bağlı bu yönetmelik kapsamında, hâkim işletmeye bağlı işletmeye ilişkin hükümlerin uygulanacağı esası da ayrıca kabul edilmiştir. Ayrıca, Resmi İstatistik Programı kapsamında kurum ve kuruluşlarca yürütülecek çalışmalarda yapılacak sınıflandırmada da çalışan sayıları 5 grupta toplanarak yeni kategoriler oluşturulmuştur ve Kobilere dair istatistikler bu çalışan sayılarına göre derlenerek yayınlanmaktadır. Bu kategoriler:

- a) Yıllık çalışan sayısı 0-1 kişi,
- b) Yıllık çalışan sayısı 2-9 kişi,
- c) Yıllık çalışan sayısı 10-49 kişi,
- d) Yıllık çalışan sayısı 50-249 kişi,
- e) Yıllık çalışan sayısı 249'dan fazla.”

Kobiler özellikle;

Girişimcilikte,

İmalat sanayinde,

İstihdama katkıda,

İç ve dış ticarete,

KOBİ'ler ülke ekonomisinde çok önemli rol oynamaktadır ve bu rollerine paralel olarak devletçe önemli ölçüde desteklenmektedirler.

Türkiye'de KOBİ'lere yönelik, birçok kamu kuruluşu ve özel kuruluş tarafından sağlanan doğrudan veya dolaylı destek ve teşvikler söz konusudur. KOBİ'lere yönelik destekleri, kuruluş aşamasından, girdi teminine ve pazarlamaya kadar tüm eylemlerinin desteklenmesi biçiminde tanımlamak mümkündür.

Destekler tabiri birçok motivatörü kapsar şekilde kullanılmaktadır. Ancak ve çoğu kez, istatistiksel veriler «Destekler» başlığı dışında «Teşvikler» tanımlamasıyla da ayrıca derlenmektedir. İster «Destekler», isterse «Teşvikler» başlığı altında olsun tüm bu istatistiksel verilerin analizi sonucu KOBİ'lerin gelişme süreçleri boyunca dış ticarete, özellikle ihracatta, yüksek oranlı pay aldıkları ve

buna bağlı olarak da önemli ölçüde desteklendikleri görülmektedir. Ancak, KOBİ'lerin ihracattaki paylarının 2012 yılını takiben azalma eğilimine girdiği görülmektedir.²² Bu çalışmada bu azalma eğiliminde devlet desteklerinin bir fonksiyonu olup olmadığı araştırılarak devlet destekleri-teşvik uygulaması etkisi ile ilgili bulgulara ve önerilere yer verilmektedir.

2. VERİ, YÖNTEM VE UYGULAMA

Bu çalışma ile 2018 yılı itibarıyla Türkiye'de ülke ihracatına katkıları açısından KOBİ'lere (Küçük ve Orta Büyüklükte İşletme) yapılan devlet desteklerinin bir analizi ve değerlendirmesi amaçlanmıştır. Araştırma öncelikle mevzuat çerçevesinde ele alınmakta olup konuya ilişkin akademik diğer bulgular incelenmekte ve yorumlanmaktadır. Ayrıca, Denizli ilinde Denizli Sanayici ve İşadamları Derneği (DESİAD) üyelerinde 20 KOBİ işletme sahibi girişimcilerle yüz yüze görüşme ile (odak görüşmelerle) düşünceleri alınmıştır. Yapılan analiz ve değerlendirmeyi takiben Denizli ili özelinde, ilde faaliyet gösteren firmalara seminerlerle bilgilendirme yapılması planlanmaktadır.

3. KURUMSAL ÇERÇEVE VE TÜRKİYE' DE KOBİLERİN ETKİNLİKLERİ İLE ÜLKE EKONOMİSİNE ETKİLERİ

KOBİ'ler tek başlarına küçük birer ekonomik birimdir ve tek tek ele alındıklarında ekonomiye olan katkıları yok denecek kadar az olarak düşünülmektedir ancak ekonomideki işlevleri ve sayısal çokluklarınca değerlendirildiğinde ekonomi ve sosyal yapı için çok çok önemli ve değerli oldukları anlaşılmaktadır. (Özdemir, Ersöz ve Sarıoğlu, 2007).

Dünyadaki mevcut ekonomiler incelendiğinde işletmelerin neredeyse % 95-99'unu KOBİ'lerin oluşturduğu anlaşılmaktadır. Ekonomilere dönük diğer katkıları değerlendirildiğinde ise: % 40-80 istihdam etkisi, % 30-70 GSMH payı, yatırımlarda % 30-60 oranında rol alma, ihracatta % 10-40 pay ile KOBİ'ler çok değerli faaliyet ve fayda ortaya koymaktadırlar (Özdemir vd. 2007).

Ülkemizde de KOBİ'ler bu benzer özelliklerle ekonomide ve toplumsal düzende önemli aktörler olmaktadır. TÜİK' in 2015 yılı verilerinden elde edilen değerlendirmelere göre Türkiye' de:

Toplam işletmelerin %99,9'nu KOBİ'ler oluşturmaktadır,

Toplam mal ve hizmet satın alımlarında %65,5 pay sahibidirler,

Üretim değerindeki payları, %56,2'dir.

Maddi mallara ilişkin brüt yatırımdaki payı, %53,2'dür.

Çalışanların %75,8'i KOBİ'lerdedir,

Toplam katma değer %55'i,

Toplam satışların %65,5'i,

Toplam yatırımların %50'si,

²² TÜİK, "Haber Bülteni-25.11.2016, Sayı 21540" ve TOBB, "Kobi İstatistikleri"

Bankacılık sektörü toplam kredilerinin %26'sı

İthalatın %39,9'u

İhracatın %59,2'si KOBİ'lerce oluşturulmaktadır (TÜİK, 2015) .

KOBİ'lerin ana sektör gruplarına göre dağılımı ise şu şekildedir:

Tablo 3. Türkiye'de KOBİ'lerin ana sektör gruplarına göre dağılımı

| Sektör | Dağılım Oranı |
|---------------|---------------|
| Tarım | %9 |
| Sanayi | %12,5 |
| Ticaret | %51,4 |
| Diğer | %35,2 |
| Toplam | %100 |

Kaynak: TOBB; <http://www.kobi.org.tr/index.php/tanimi/layout>

Dış ticarete girişimciler her dönemde ekonomik yapının temel taşı olmuşlardır. Tarih boyunca gerek yeni ticaret yollarının bulunması gerekse bilimsel ve teknolojik ilerlemelerin yaşanması girişimciliğin önemini daha fazla ortaya koymuştur. Girişimciler ile dış ticarete bulunan ülkeler karşılıklı ilişki içerisindeyler. Girişimci ticaret yoluyla ilişki içerisinde bulunduğu ülkenin ekonomik, siyasi, kültürel ve teknolojik koşullarından etkilenirken, ticaret yapılan ülkeler de aynı koşullarda karşılıklı etkileşimde bulunmaktadır (Şeker, Doğan, Elitaş, 2016:202).

KOBİ'lerin girişimcilik değerleri ile dış ticaret faaliyetleri arasında olumlu bir ilişki bulunduğu görülmüştür. KOBİ'ler ekonomik faktörlerin vazgeçilmez bir ögesi; aktif girişimciler olarak yenilikçilik, pazar ve üretim bilgisine sahip olma, oluşabilecek riskleri üstlenme, iş yönetimindeki ve organizasyonundaki yetenekleri sayesinde dış ticaretteki yoğun rekabet koşullarına çabuk uyum sağlayabilmektedirler (Şeker vd. 2016).

1980'lerin başından KOBİ'lerin desteklenmesini amaçlayan ciddi yaklaşımlar ortaya çıkmıştır. KOBİ'lerin büyüme, istihdam, sanayileşme ve kalkınma açısından önemli role sahip oldukları fikri KOBİ'lerin geliştirilmesi ve desteklenmesi noktasında ülkeler arayışa geçmiştir. 1980'lerle birlikte dünya ülkeleri KOBİ'lerin geliştirilmesi ve teşvik edilmesine yönelik politikalar izlemeye başlamışlardır (Maden, S.I. Dulupçu, M.A. 2014:181).

KOBİ'lerin teknik yeniliklere daha yatkın, tüketici tercihlerine yönelik daha esnek karakterde olduklarından, bu işletmeler yapıları itibarıyla konjonktürel dalgalanmalara daha kolay uyum sağlayabilmektedirler. Bununla birlikte, KOBİ'ler üretimdeki boşlukları daha hızlı doldurabilmekte ve dengeli büyüme açısından esnek yapıları itibarıyla katkıları daha yüksek olabilmektedirler ki ihracata dayalı büyüme ve kalkınma açısından destekler ve teşvikler için büyük kuruluşlara nazara ülke yönetimleri için daha cazip addedilmektedirler. (Maden, S.I. Dulupçu, M.A. 2014:182).

KOBİ'lerin yukarıda ifade edilen özellikleri dikkate alınarak ve birlikte olmaları halinde daha büyük organizasyonlar bünyesinde ürünlerinin yurt dışı satış ve pazarlamasında daha rekabetçi olacağı görülmüştür. Bu görüşe bağlı olarak KOBİ'lerin ve ülke genel ihracatın artırılması için yeni organizasyonlar geliştirilmiş ve bu bağlamda Dış Ticaret Sermaye Şirketleri ve Sektörel Dış Ticaret Şirketleri oluşturulmuştur. İhracata yönelik bu örgütlenme modelleriyle; KOBİ'lerin bireysel olarak ihracat yaptıklarında karşılaşılabilecek zorlukları aşabilmeleri, bireysel pazarlama etkinliklerine göre daha güçlü pazarlama imkânları edinebilmeleri mümkün olabilmektedir.

Dış Ticaret Sermaye Şirketi; T.C. Dış Ticaret Müsteşarlığı tarafından, ödenmiş sermayeleri en az 2 milyon TL. olan ve bir önceki takvim yılında gümrük beyannamesi bazında; en az (FOB) 100 milyon ABD doları veya eş değerdeki fiili ihracatı gerçekleştiren (transit ve bedelsiz ihracat hariç) anonim şirketlere verilebilen statüdür.²³

Sektörel Dış Ticaret Şirketleri ise; aynı üretim dalında faaliyet gösteren KOBİ'lerin bir araya gelerek, gerekli şartları sağlamaları halinde, kurabilecekleri şirketlerdir.

Dış Ticaret Müsteşarlığınca "Sektörel Dış Ticaret Şirketi (SDŞ)" Küçük ve Orta Büyüklükteki İşletmelerin (KOBİ) ihracat sektörü içinde bir organizasyon altında toplanarak dünya pazarlarına yönlendirilmesi amacıyla; ihracat ve ilgili konularda (finansman, tedarik, nakliye, sigorta, gümrükleme vb.) hizmet sağlayarak, dış ticarete uzmanlaşmalarını ve bu suretle daha etkin faaliyet göstermelerini teminine çalışılmıştır.²⁴

Sektörel Dış Ticaret Şirketleri'nin ihracat performansları ile ilgili olarak gerçekleştirilen araştırmaya göre Türkiye'de KOBİ'ler ülke ekonomisinde istihdam, yatırım ve üretimde önemli yere sahip oldukları halde ihracat konusunda karşılaştıkları sorunlar sebebiyle ihracat içindeki payları düşük kalmıştır. Diğer taraftan, Türkiye'deki KOBİ'lerin ihracatta örgütlenerek yeni oluşturulan bu dış ticaret birlikteliğine dönük şirketler ihracattaki gelişimi artırıcı nitelik arz etmiştir (Bedük ve İnce, 2005). Başlangıçta bu şirketler KOBİ'leri birbirleriyle rekabet etmekten alıkoysa da sonrasında bu etkinin kaybolduğu herkesçe bilinen bir gerçektir.

KOBİ'lerin üretim hacminin sınırlı olması aynı zamanda, kalite, fiyat ve marka sorunlarını da beraberinde getirmektedir zira KOBİ'lerin kullandıkları hammadde ve ara mallarını küçük miktarlarda almaları bu kalemlerde kalite standardı ve fiyat pazarlığı imkânını sınırlamaktadır. Bu durum neticesinde ürünün fiyatı ve kalitesi yönlerinden KOBİ'ler dezavantajlı konuma düşmektedirler.

²³ "Dış Ticaret Sermaye Şirketi Statüsüne İlişkin Tebliğ (İhracat: 2004/12)", Resmi Gazete Tarihi: 08.12.2004 Resmi Gazete Sayısı: 25664

²⁴ "Sektörel Dış Ticaret Şirketleri Statüsüne İlişkin Tebliğ (İhracat 2004/ 4)", Resmi Gazete Tarihi: 02.07.2004 Resmi Gazete Sayısı: 25510

KOBİ'ler kendileri ihracat yaptıklarında tüm ihracat giderlerini karşılamak durumundadırlar. Bu giderlerin bir kısmı değişken ve önemli bir kısmı da sabit maliyetlerden oluşmaktadır. Sektörel Dış Ticaret Şirketleri, ortakları olan çok sayıda işletmenin ihracat işlemlerini tek elden yürüttükleri için söz konusu sabit maliyetlerin azalmasında etkili olmaktadır.

Türkiye' deki KOBİ'lerin istatistik verilerine yansıyan ülke toplam ihracatı içerisindeki pay rakamları doğrudan ve dolaylı yaptıkları ihracatların toplamına tekabül etmektedir. Ne yazık ki doğrudan yaptıkları ihracatların payı çok daha azdır ve KOBİ' dışı kuruluşlarla yapılan ihracatlarda fason ve/veya bir başka tedarikçilik fonksiyonuyla dış ticarete yer almaktadırlar (Özdemir vd., 2007).

Tablo 4. Türkiye' de KOBİ'lerin İhracat ve İthalattaki Payları

| YIL | İhracat Payı | İthalat Payı | İhracat' ın İthalatı Karşılama Oranı |
|------|--------------|--------------|--------------------------------------|
| 2012 | 62,60% | 38,50% | 1,63 |
| 2013 | 59,20% | 39,90% | 1,48 |
| 2014 | 56,40% | 37,80% | 1,49 |
| 2015 | 55,10% | 37,70% | 1,46 |

Kaynak: TÜİK, "Haber Bülteni-25.11.2016, Sayı 21540"

Tablo 4 de görüldüğü üzere KOBİ'lerin ihracattaki payı 2012 yılından itibaren giderek azalmaktadır. 24 Ocak 1980 kararları ile ihracata dayalı büyüme modelinin benimsendiği 1980 sonrası uygulanan dışa açılma politikalarının gereği olarak kredi ve diğer mali desteklerle ihracat teşvik edilmiştir. Bu modelin diğer bir yansıması ise ithalat yönündedir. Daha sonra yapılan araştırmalar göstermektedir ki ihracatın artışı ithalatın artışıyla mümkün olmaktadır (Çamurdan, B. 2013). Tablo 4 de izlenebileceği gibi ithalat paylarında azalma çok az olmasına rağmen KOBİ'lerin ihracattaki payında azalma eğilimi, yani ihracatlarının ithalatlarını karşılama oranı giderek düşmektedir.

KOBİ'leri ihracata yönelten çeşitli faktörler vardır. Bunlardan en önemlileri:

Satış ve kârını artırmak,

Büyüme

Pazar darlığı,

Pazardaki yüksek rekabet,

İç pazara olan bağımlılığı azaltmak,

İç pazarda talebin az olması (enflasyon, dönemsel dalgalanma vb.)

Dünya piyasalarından pay almak,

Atıl kapasiteye sahip olma,

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Dış pazarlarda güçlü rakiplerin mamulleriyle rekabeti öğrenerek, iç pazarlarda da güçlü hale gelmek,

Ülke dışındaki potansiyel pazar fırsatlarını değerlendirmek,

Ülke dışından üretilen ürünlere yönelik talep oluşması,

Dış pazarlardaki vergi ve diğer teşvik avantajlarından yararlanmak şeklinde sıralamak mümkündür (Çetinkaya Bozkurt, Ö. ve Tunç, H. (2018:382).

Türkiye’de KOBİ’ler yukarıda bahsedilen faktörlerle ihracata yöneldiklerinde işlemleri gerçekleştirirken çok fazla engel ve sorunlarla karşılaşmaktadırlar. Bu engel ve sorunları tespit için yapılan birçok araştırma yapılmıştır. Araştırmalar söz konusu sorunların yıllar içinde çok da fazla değişmediğini göstermektedir (Çetinkaya Bozkurt, Ö. ve Tunç, H. 2018:386).

(Çetinkaya Bozkurt, Ö. ve Tunç, H. 2018:386) çalışmasında KOBİ’lerin ihracatta karşılaştıkları sorunlar ve kaynakları incelenmekte ve bu alanda yapılan diğer araştırmalar tablolştırılmış olarak detaylı bir şekilde sunulmaktadır. Yine aynı araştırmada, Örgüt Dışından Kaynaklanan Sorunlar başlığı altında, bu çalışmamız konusuyla doğrudan ilintili olan bir husus olarak; devlet desteklerinin ve teşvik tedbirlerinin yetersiz olması durumunun ihracat pazarlarındaki rekabetin önemi nedeniyle özellikle vurgulamaktadır.

KOBİ’lerin örgüt dışındaki nedenlerden kaynaklanan ihracatta karşılaşılan sorunları arasında yer alan önemli diğer hususlar ise:

Ülke ekonomisindeki istikrarsızlık,

Ihracatta yaşanan bürokrasi ve prosedürler,

Yabancı ülkelerin uyguladığı kotalar,

Rakipler ve rekabetin şiddeti,

Banka hizmetlerinin yetersiz olması,

Navlun sigorta bedellerinin yüksek olması,

Dövizdeki dalgalanmalar,

Ülke imajı,

Kültür farkı,

Farklı müşteri tutumları,

Dil ve iletişim farklılıkları,

Yüksek tarife ve tarife dışı engellerdir (Köksal & Kettaneh, 2011:113).

Denizli Sanayici ve İşadamları Derneği (DESİAD) üyeleriyle yapılan odak görüşme çerçevesinde devlet desteklerinin ihracatlarında önemli rol oynadığı, söz konusu destek ve teşviklerinden olabildiğince

yararlanılmaya çalışıldığı ancak bazı hususlar nedeniyle beklenen etki elde edilememektedir yorumu yapılmaktadır. Özellikle bürokratik işlemler, destek ve teşviklerin çok ayrı merkezlerden kullanılabilmesi ile farklı yörelere (bölgesel dağılım) uygulanan destek ve teşviklerin dağılımındaki ciddi farklılıklar bulunması demotive edici unsurlar olarak belirtilmiştir. Benzer tespitler Kalkınma Bakanlığı tarafından düzenlenen 11. Kalkınma Planı Şubat 2017 Çalıştay Girişimcilik, KOBİ'ler, Esnaf ve Sanatkarlar oturumlarında da gündem almış olup ivedilikle çok merkez yerine toplulaştırılarak ve kolay izlenebilir hale getirilmesi ve uygulanması önerileri yapılmıştır. Konuya ilişkin bir diğer irdeleme ise (Takım, A. Ve Ersungur, M. 2018:740) çalışmasında yer almaktadır. Söz edilen çalışmada "...Birbirinden kopuk, stratejik bütünlükten yoksun, hedef ve amaçları dağınık, çok başlı bürokrasinin elinde "çarçur olan" kaotik bir teşvik yapısı. Her şeyi teşvik ederek sonuçta hiçbir şeyi teşvik etmeyen bir teşvik yapısı... Herkesin peşinde koşup da asla memnun olmadığı; arada memnun olanlar varsa da, istisna kaldığı bir teşvik yapısı..." yorumuyla Türkiye'deki teşvik sistemi özetlenmektedir.

3.1. KOBİ'lere Yapılan Destekler ve Teşvikler

İhracata dayalı büyüme modelinin benimsendiği 1980 sonrası uygulanan dışa açılma politikalarının gereği olarak kredi ve diğer mali desteklerle ihracat teşvik edilmiştir. Ekonomi politikalarında yapısal değişimin yaşandığı 1980 sonrası dönemde ithalat kademeli olarak serbestleştirilirken, ihracat ise vergi iadesi, enerji desteği, düşük faizli kredi gibi doğrudan parasal desteklerin yanında imalatçı ihracatçılara yönelik ithal girdilerde gümrük muafiyeti ve sektörlere göre farklılaşan teşvik sistemi ile desteklenmiştir. Ancak, genel olarak dış ticaretin, özelde ihracatın teşviki ile yapılan direkt parasal ödeme şeklindeki nakit teşvikler, diğer ülkelerin iç piyasalarına zarar verdiği gerekçesi ile Dünya Ticaret Örgütü Anlaşması ve AB ile Gümrük Birliğine girilmesi nedeniyle uygulanabilirliğini yitirmiştir. Dolayısıyla parasal teşvikler yerine ihracatçıların dış pazarlarda rekabet gücünü artırmak amacıyla 1987 yılında kurulan Türk Eximbank yoluyla sağlanan ihracat kredi ve sigorta programları uygulanmaya başlanmıştır.

Türkiye ekonomisinde öteden beri en çok tartışılan konuların başında teşvikler gelmektedir. Türkiye ekonomisinde 1990'lı yıllardan itibaren kamuda yaşanan kaynak sıkıntısı yatırımları teşvik etmek amacıyla ayrılan fonları azaltmış, nakdi krediler önemli ölçüde kaldırılmış ve bölgesel teşvikler ve vergisel teşvikler öne çıkmaya başlamıştır. Genel olarak teşvikler amaçlarına, araçlarına, hangi aşamada verildiğine (yatırım ya da ihracat öncesi ve sonrası) ve kapsamına göre sınıflandırılmaktadır. Amaçlarına göre teşvikler yatırımları, üretimi ve istihdamı artırma; araçlarına göre aynı ya da nakdi teşvikler; kapsamına göre ise genel ve özel teşvikler olarak sınıflandırılmaktadır. Teşvikler çok farklı şekillerde sınıflandırılrsa da en yaygın olarak ekonomik faaliyetlere göre sınıflandırılmakta ve bu ayırıma göre yatırım ve ihracat teşvikleri olmak üzere iki başlık altında incelenmektedir (Takım, A. Ve Ersungur, M. 2018:728).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

KOBİ'lere yönelik destekleri, kuruluş aşamasından, girdi teminine ve pazarlamaya kadar tüm eylemlerinin desteklenmesi biçiminde tanımlamak mümkündür (Demirci, 2001: 224). Türkiye'de KOBİ'lere yönelik, birçok kamu kuruluşu ve özel kuruluş tarafından sağlanan doğrudan veya dolaylı destek ve teşvikler söz konusudur. KOBİ'lere yönelik desteklerin büyük bir kısmı devlet tarafından karşılanmaktadır ancak; başta bankalar olmak üzere özel sektör ve çeşitli meslek odaları tarafından da önemli destekler sağlamaktadır. Bu kurum ve kuruluşları, genel olarak 5 ana grupta toplamak mümkündür (Akgemici, 2001: 39; Özdemir, 2006: 187-190) :

1- Kamu Kurum ve Kuruluşları:

KOSGEB,

Türkiye Halk Bankası,

EXIMBANK, Sınai Yatırım ve Kredi Bankası, Türkiye Vakıflar Bankası,

KOBİ A.Ş., Kredi Garanti Fonu, Sanayi ve Ticaret Bakanlığı, Milli Eğitim

Bakanlığı ve YÖK, GAP Bölgesi Girişim Destekleme ve Yönlendirme

Merkezi, Maliye Bakanlığı Milli Emlak Genel Müdürlüğü, MPM (Milli

Prodüktivite Merkezi), Hazine Müsteşarlığı, Dış Ticaret Müsteşarlığı, DPT,

TÜİK, İŞKUR.

2- Mesleki Kuruluşlar:

Ticaret ve Sanayi Odaları, TOBB, Esnaf Kefalet

Kooperatifleri, Küçük Sanayi Kooperatifleri.

3- Özel Kuruluşlar:

TOSYÖV,

MEKSA,

Türk Pazarlama Vakfı,

Teşebbüsü Destekleme Ajansı.

4- Teknik Yardım ve Danışmanlık Hizmetleri Veren Diğer Kurum ve Kuruluşlar:

Üniversiteler, TESK, İGEME, TSE, İKV, İlgili Meslek Kuruluşları,

İşçi ve İşveren Kuruluşları.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

5- Yurtdışı Destekli Diğer Kurum ve Kuruluşlar:

Dünya Bankası,

Birleşmiş Milletler Sınai Kalkınma Örgütü (UNIDO) Ankara Bürosu,

Avrupa Yatırım Bankası (EIB), Avrupa Birliği Genel Sekreterliği, Avrupa

Küçük İşletmeler Konseyi, Hollanda Yönetim İşbirliği Programı, Balkan

Ülkeleri Ticareti Geliştirme Bölge Merkezi.

KOBİ politikalarını belirlerken, Hazine ve DTM yatırım ve ihracat teşviklerini, Maliye Bakanlığı ise vergi ile ilgili teşvik ve muafiyetleri belirlemektedir. KOBİ politikalarının temel uygulayıcısı kurum ise KOSGEB'dir. KOSGEB; küçük ve orta ölçekli sanayi işletmelerinin teknolojik yeniliklere hızla uyumlarını sağlamak, rekabet güçlerini yükseltmek, ekonomiye katkılarını ve etkinliklerini artırmak amacıyla 3624 sayılı Kanunla 20.04.1990 tarihinde Türkiye'de KOBİ'lere Yapılan Destekler ve İstihdam Üzerindeki Etkileri kurulmuştur (KOSGEB, 1990: 1). KOSGEB, KOBİ'lere verilmesi gereken destekleri ya bizzat veren ya da koordine eden ana kuruluştur.

Türkiye'de Uygulanan İhracat Teşviklerinden bazıları (Takım, A. Ve Ersungur, M. 2018:728):

İhracata Yönelik Devlet Yardımları

İhracata Hazırlık Aşaması: Hazırlık aşamasında sağlanan devlet yardımlarından biri UR-GE, diğeri ise Pazara Giriş Belgelerinin Desteklenmesidir.

Pazarlama Aşaması Destekleri: Pazar Araştırması, Rapor ve Yurtdışı Şirket Alım, Sektörel Ticaret ve Sektörel Alım Heyetleri, E-Ticaret Sitelerine Üyelik Destekleri

Yurtdışı Birim, Marka Tescil ve Tanıtım Desteği

Türkiye Ticaret Merkezleri Desteği

Küresel Tedarik Zincirleri Yetkinlik Projeleri

İhracat Kredi Sigorta Programı Desteği ve Alıcı Kredisi Desteği

Yurt Dışı ve Yurtiçi Fuar Desteği

Markalaşma Aşaması: Turquality Desteği ve Tasarım Desteğidir.

İhracatçılara Hususi Damgalı Pasaport Verilmesi: Mal ihracatı yapan gerçek ve tüzel kişilerin ürünlerini yurtdışı pazarlarda daha etkin bir şekilde tanıtımını sağlamak amacıyla 2018 yılında uygulamaya konulan bir ihracat desteğidir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Hizmet Sektörlerine Yönelik Devlet Yardımları: Döviz kazandırıcı hizmetler sektörlerine yönelik olarak uygulanan bir destek biçimidir. Antrepo, Elleçleme ve otomasyon hizmetlerini birlikte içeren, asgari toplam kapalı alanı 10.000 m2 olan entegre lojistik yatırımları için uygulanmaktadır,

Türk Eximbank Destekleri:

Serbest Bölgelerde Yatırım ve Faaliyetlere Sağlanan Devlet Destekleri,

Ticaret Bakanlığınca Yürütülen İhracat Destekleri: Dâhilde İşleme Rejimi (DİR), Hariçte İşleme Rejimi (HİR).

Diğer Destekler: Onaylanmış Kişi Statüsü (OKS), Yetkilendirilmiş Yükümlü Statüsü (YYS),

Dış Ticaret Şirketleri, Dış Ticaret Sermaye Şirketleri ve Sektörel Dış Ticaret Şirketleri:

Sınır Ticareti ve Sınır Ticaret Merkezleri:

Vergi, Resim Harç İstisnası ile KDV İstisnası:

1 Ocak 2012 tarihi itibarıyla geçerli olan yeni yatırım teşvik sistemi dört ayrı rejimden oluşmaktadır.

Yerli ve yabancı yatırımcılar, aşağıdaki teşviklerden eşit oranda faydalanabilmektedir:

- 1- Genel Yatırım Teşvik Uygulamaları
- 2- Bölgesel Yatırım Teşvik Uygulamaları
- 3- Büyük Ölçekli Yatırım Teşvik Uygulamaları
- 4- Stratejik Yatırım Teşvik Uygulamaları

Tablo 5. Türkiye' de Farklı Yatırım Teşvik Rejimleri Çerçevesinde Sağlanan Destek Unsurları

| Destek Unsurları | Genel Yatırım Teşvik Uygulamaları | Bölgesel Yatırım Teşvik Uygulamaları | Büyük Ölçekli Yatırım Teşvik Uygulamaları | Stratejik Yatırım Teşvik Uygulamaları |
|--|-----------------------------------|--------------------------------------|---|---------------------------------------|
| KDV İstisnası | + | + | + | + |
| Gümrük Vergisi Muafiyeti | + | + | + | + |
| Vergi İndirimi | | + | + | + |
| Sosyal Sigortalar | | | | |
| Prim Desteği | | + | + | + |
| (İşveren Payı) | | | | |
| Gelir Vergisi Stopajı İndirimi* | | + | + | + |
| Sosyal Sigortalar | | | | |
| Prim Desteği | | + | + | + |
| (Çalışan Payı)* | | | | |
| Faiz Oranı Desteği ** | | + | | + |
| Arazi Tahsisi | | + | + | + |
| KDV İadesi*** | | | | + |
| * Yatırımın Bölge 6' da gerçekleştirilmesi halinde sağlanır. | | | | |
| **Yatırımın Bölgesel Yatırım Teşvik Uygulamaları kapsamında Bölge 3, 4, 5 veya 6'da gerçekleştirilmesi halinde sağlanır. | | | | |
| ***Asgari sabit yatırım tutarı 500 milyon TL olan stratejik yatırımların inşaat harcamaları için sağlanır. | | | | |

Kaynak: INVEST IN TURKEY, <http://www.invest.gov.tr/tr-TR/investmentguide/investorsguide/Pages/Incentives.aspx>

Türkiye'de KOBİ'lere yönelik, birçok kamu kuruluşu ve özel kuruluş tarafından sağlanan doğrudan veya dolaylı destek ve teşvikler söz konusudur. İster «Destekler», isterse «Teşvikler» başlığı altında olsun tüm bu istatistiksel verilerin analizi sonucu KOBİ'lerin gelişme süreçleri boyunca dış ticarete, özellikle ihracatta, yüksek oranlı pay aldıkları ve buna bağlı olarak da önemli ölçüde desteklendikleri görülmektedir.

KOSGEB tarafından 2003 yılı öncesinde çok düşük miktarlarda ve çok az sayıdaki işletmeler desteklemiştir. Fakat 2003 yılından itibaren aşırı bir artış olmuştur. Bu artış, KOSGEB'in 2003 yılında başlattığı yeniden yapılanma çalışmaları sonucu sağlanmıştır. KOSGEB, kendi kaynağını bankalar aracılığıyla kullanılmak suretiyle kredi uygulaması başlatmış, kamu bankaları aracılığıyla sıfır faizli kredi uygulaması başlatmış, KOBİ'lere ihracat, istihdam ve yatırım kredileri kullandırmış, destek ödeme tutarlarını artırmıştır ve 8 olan destek sayısını 38'e (22 başlık altında) yükseltmiştir (Ulusoy, R

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

ve Akarsu, R. 2012:115). KOSGEB tarafından KOBİ'lere sunulan başlıca destekler (TOBB-KOBİ, “Destek ve Teşvikler”:

1. KOBİ Proje Destek Programı
2. Tematik Proje Destek Programı
3. İşbirliği Güç birliği Destek Programı
4. AR-GE, İnovasyon ve Endüstriyel Uygulama Destek Programı
5. Genel Destek Programı
6. Girişimcilik Destek Programı
7. Gelişen İşletmeler Piyasası KOBİ Destek Programı
8. Kredi Faiz Desteği

Ticaret Bakanlığı tarafından yürütülmekte olan ihracata yönelik devlet yardımları, yurtdışına açılma sürecinde firmalara destek sağlanmasını amaçlayan bütünsel bir bakış açısıyla sürdürülmektedir. Desteklerde ihracata hazırlık, pazarlama ve markalaşma olmak üzere üç olgunluk seviyesi bulunmaktadır. Bu destekler:

Pazar Araştırması ve Pazara Giriş

Yurt Dışı Pazar Araştırması,

E-Ticaret Sitelerine Toplu Üyelik,

Rapor, Danışmanlık, İleri Teknolojili Şirket ve Marka Satın Alma,

Sektörel Ticaret Heyetleri, Alım Heyetleri

Pazara Giriş Belgeleri

Pazara Giriş Belgeleri ve Küresel Tedarik Zinciri (KTZ) Yetkinlik Projeleri

Uluslararası Rekabetçiliğin Geliştirilmesinin Desteklenmesi

UR-GE Projeleri

İhracatçıya Alıcı Kredisi ve Sigorta Tazmin Desteği

Fuar Katılım Desteği

Tasarım Desteği

Yurtdışı Birim, Marka ve Tanıtım Desteği

Markalaşma ve Turquality Desteği

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Tarımsal Ürünlerde İhracat İadesi Yardımları

KOBİ'lere destek ve teşvik uygulaması açısından Eximbank çok önemli bir konumdadır. Türk Eximbank ihracatçı ve ihracat bağlantılı mal üreten imalatçı firmalara, birçok fırsat tanırken parasal destekleri önemli ölçüde etkindir. Eximbank bu anlamda kısa-orta ve uzun vadeli ihracat kredileri tahsis etmektedir. Bu krediler TL ve döviz cinsinden, bankalar aracılığıyla veya doğrudan Türk Eximbank tarafından firmalara kullanılmaktadır. Bu krediler ile diğer destek ve teşvikler (Türkiye İhracatçılar Meclisi: TİM):

1-Kısa vadeli ihracat kredileri:

Reeskont Kredisi (RK)

Sevk Öncesi İhracat Kredileri (SÖİK)

İhracata Hazırlık Kredileri (İHK)

Dış Ticaret Şirketleri İhracat Kredisi (DTŞ)

KOBİ İhracata Hazırlık Kredileri

Sevk Sonrası Reeskont Kredisi (SSRK)

2-Orta ve uzun vadeli ihracat kredileri:

İhracata Yönelik İşletme Sermayesi Kredisi

İhracata Yönelik Yatırım Kredisi

Marka Kredisi

Avrupa Yatırım Bankası (AYB) Kredisi

Yurt Dışı Mağazalar Yatırım Kredisi

Özellikli İhracat Kredisi

Gemi İnşa ve İhracatı Finansman Programı

KOBİ'lere sağlanan teşvikler (TOBB-KOBİ, “ Destek ve Teşvikler”):

Ticaret Bakanlığı Teşvikleri,

Kültür Ve Turizm Bakanlığı Teşvikleri,

Bilim, Sanayi Ve Teknoloji Bakanlığı Teşvikleri,

İŞ-KUR Teşvikleri,

Gelir İdaresi Başkanlığı Teşvikleri.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Bilim, Sanayi ve Teknoloji Bakanlığı Teşvikleri:

1. Küçük Sanayi Siteleri Teşvikler
2. Endüstri Bölgelerinde Uygulanan Teşvikler
3. Teknoloji Geliştirme Bölgelerinde Uygulanan Teşvikler
4. Organize Sanayi Bölgeleri Teşvikleri

İŞKUR Teşvikleri:

1. Aktif İstihdam Programları

Girişimcilik Eğitimleri,

İşbaşı Eğitim Programları,

Toplum Yararına Çalışma Programları,

Çalışanların Mesleki Eğitimi ile ilgili kurs programları.

2. Pasif İstihdam Programları

İşsizlik Sigortası

Ücret Garanti Fonu

Kısa Çalışma Ödeneği

İş Kaybı Tazminatı

SGK Prim Teşviki Uygulaması

Gelir İdaresi Başkanlığı Teşvikleri

193 Sayılı Gelir Kanunu'nda Yer Alan Vergisel Teşvikler

5520 Sayılı Kurumlar Vergisi Kanunu'nda Yer alan Vergisel Teşvikler

3065 Sayılı Katma Değer Vergisi Kanunu'nda Yer Alan Vergisel Teşvikler

4325 Sayılı Olağanüstü Hal Bölgesinde Ve Kalkınmada Öncelikli Yörelere İstihdam Ve Yatırımların Teşviki Hakkında Kanunda Yer Alan Vergisel Teşvikler

488 Sayılı Damga Vergisi Kanunu'nda Yer Alan Vergisel Teşvikler

492 Sayılı Harçlar Kanunu'nda Yer alan Vergisel Teşvikler

4.GENEL DEĞERLENDİRME VE SONUÇ

Dünyanın geleceği ekonominin, üretimin, hakça paylaşımın, planlı çalışmanın, inovasyon peşinde koşmanın ve bilginin gelişmesine doğrudan bağlıdır. Ekonomilerin büyümesi kalkınma için çok önem arz etmektedir. 24 Ocak 1980 kararlarıyla Türkiye ekonomisinin temel paradigması değişmiş ve bu kararlarla birlikte Türkiye dış dünyaya açılarak ihracata dayalı bir büyüme modelini kalkınma için temel almıştır. Kalkınmanın dinamikleri ekonomik büyüme temeline oturtulurken gerekli ihracat hamlesinin yükünü çeken ve aynı zamanda onuruna sahip olan girişimciler ise “Küçük Orta Büyüklükte Şirketler” dediğimiz “KOBİ’ler olmuştur.

KOBİ’ler sadece ihracata dayalı büyümede değil aynı zamanda üretim, istihdam, vizyonerlik ve yenilikçilik gibi ekonominin çok gereksinim duyduğu alanlarda da söz sahibi konumundadırlar. Tüm araştırmalar ve istatistikler bu bulguları doğrular niteliktedir.

Ekonominin motoru konumunda bulunan KOBİ'lerin bugünkü duruma ulaşmaları elbette kolay olmamış ve KOBİ'ler çok sorunlu aşamalardan geçmiştir. Bu sorunları gidermek için özellikle Cumhuriyetin ilk yıllarında Devlet, KİT'lerle bu girişimci kesime öncülük etmiş ve daha sonra yavaş yavaş bazı alanlardan çekilerek yerini özel teşebbüse bırakmıştır ama yine de KOBİ'lere devlet desteği devam etmiştir.

Türkiye’ de KOBİ’lerin ortaya çıkmasında ve ekonomide ve dış ticarete ciddi bir aktör olmasında devlet teşvik ve desteklerinin önemli rol oynadığı ortadadır. Kamu tarafından önceleri çok düşük miktar ve tutarlarda ve çok az sayıdaki işletmeleri desteklenirken son yıllarda artan bir destek ve teşvik uygulanmıştır.

KOBİ’lerin dış ticarete önünün iyice açılması yatırım kredileri kullanılması, destek ödeme tutarlarının artırılması, çok az sayıdaki destek sayısının 22 başlık kapsamında, 38 tipte uygulamaya konulması sayesinde gerçekleşmiştir. Özellikle KOSGEB’in yeniden yapılanma çalışmaları sonucu ve kendi kaynağını bankalar aracılığıyla kullanması suretiyle kredi uygulaması başlatmış olması, kamu bankaları aracılığıyla sıfır faizli krediler, KOBİ’lere ihracatlarını artırma imkânı sağlamıştır.

Son yıllarda Halk Bankası, Kredi Garanti Fonu, Eximbank, Dış Ticaret Müsteşarlığı, Ziraat Bankası ve Dünya Bankası tarafından da KOBİ’lere önemli destekler sağlanmıştır. Ancak, yıllar geçtikçe Eximbank desteklerinde önemli bir gerileme de söz konusudur zira Eximbank kaynak yaratmada atıl kalmıştır.

KOBİ’lerin özellikle imalat sanayinde üretim ve yurtdışı satışlar ve teslimleri için atacağı her yeni adım ülke geleceği için atılacak en önemli adımlardan olacaktır.

Türkiye ekonomisinin güncel olarak yaşadığı en önemli sorunlardan birisi olan işsizliğin azaltılması için girişimciliğin mutlaka özendirilmesi gereğinden yola çıkılarak KOBİ’lere destek ve teşviklerde ciddi yükseltmeler sağlanması ayrıca önemsenmelidir.

KOBİ'lerin bir diğer önemli özelliği ise hür teşebbüse ivme kazandırması ve yurtdışı temaslarla iş kültürü geliştirerek know-how oluşturma kabiliyeti kazandırmasıdır. KOBİ'lerin yurt dışı temaslarının ve yurtdışı satış ve teslimlerle ekonominin ihtiyaç duyduğu yabancı para kazanımlarının artırılması için mevcut destek ve teşviklerin önemli ölçüde yükseltilmesi gereği aşikârdır. Bölgelerarası dağılımda da daha adil ve dengeli olunması motivasyonu artıracaktır.

Teşvik sisteminin basitleştirilerek yeniden düzenlenmesi, teşvik araçlarının uluslararası yükümlülüklerimizle uyumlu hale getirilmesi ve etkinliğinin artırılması gerekmektedir zira destek ve teşvikler çok fazla kuruluşlar tarafından yapıldığından KOBİ'lerin izleme ve anlama ve zaman ayırma imkânları oldukça zorlaşmaktadır. Daha basit, daha kolay anlaşılır ve uygulanabilir hale getirilmesi destek ve teşviklerden beklenen etkiyi artıracaktır.

KAYNAKÇA

- Ar, A.A. ve İskender, H. (2015), Türkiye'de Kobi'ler ve KOBİ'lerde Planlama, Uygulama Ve Denetim, Mevzuat Dergisi, Yıl 8, Sayı:87 Mart 2005.
- Bedük, A., İnce, M., (2005). Türkiye'de İhracatın Geliştirilmesinde Sektörel Dış Ticaret Şirketlerinin Önemi, Öneri Dergisi, Cilt 6, Sayı 23, s. 169–179.
- Çamurdan, B. (2013) Türkiye'de 1999-2013 Dönemi için İhracat, İthalat ve Ekonomik Büyüme Arasındaki Nedensellik İlişkisi, E-Journal of New World Sciences Academy, 8(4): 183-195.
- Çetinkaya Bozkurt, Ö. ve Tunç, H. (2018) Kobilerde Dış Ticaret Sorunları: Antalya İli Örneği Uluslararası Yönetim İktisat ve İşletme Dergisi, Cilt 14, Sayı 2, 2018.
- DPT Türkiye' de Kobiler ve KOSGEB, www3.kalkinma.gov.tr/DocObjects/Download/3806/kobi.pdf, (Erişim Tarihi:17.11.2018).
- INVEST IN TURKEY, <http://www.invest.gov.tr/tr-TR/investmentguide/investorguide/Pages/Incentives.aspx> (Erişim Tarihi:18.12.2018).
- KOSGEB, KOBİ Stratejisi ve Eylem Planı 2015-2018
[https://www.kosgeb.gov.tr/.../Kobi_Stratejisi_ve_Eylem_Plani_\(2015-2018\).pdf](https://www.kosgeb.gov.tr/.../Kobi_Stratejisi_ve_Eylem_Plani_(2015-2018).pdf) (Erişim Tarihi: 19.11.2018)
- Köksal, M. H., & Kettaneh, T. (2011). Export Problems Experienced by High-and Lowperforming Manufacturing Companies: A Comparative Study Asia Pacific Journal of Marketing and Logistics, 23(1), 108-126.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Maden, S.I., Dulupçu, M.A. (2014) KOBİ'leri Desteklemek Firmaların Performansını Ne Kadar Etkiler? Göller Bölgesinde KOSGEB Genel Destek Programından Yararlanan Firmalar Üzerine Bir İnceleme, Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi Y.2014, C.19, S.2, s.179-195.

Özdemir, S. Ersöz, H.Y. Sarıoğlu, İ. (2007), Küçük Girişimciliğin Artan Önemi ve KOBİ'lerin Türkiye Ekonomisindeki Yeri, Sosyal Siyaset Konferansları Dergisi, Sayı: 53
<http://www.iudergi.com/tr/index.php/sosyalsiyaset/article/view/1710>, 15.11.2018.

Resmi Gazete, Sektörel Dış Ticaret Şirketleri Statüsüne İlişkin Tebliğ (İhracat 2004/ 4), Resmi Gazete Tarihi: 02.07.2004 Resmi Gazete Sayısı: 25510. (Erişim Tarihi: 19.11.2018)

Resmi Gazete, Dış Ticaret Sermaye Şirketi Statüsüne İlişkin Tebliğ (İhracat: 2004/12), Resmi Gazete Tarihi: 08.12.2004 Resmi Gazete Sayısı: 25664 (Erişim Tarihi: 19.11.2018)

Şeker, A. Doğan, M. Elitaş, B.L. (2016) KOBİ'lerde Girişimcilik Değerleri ve Dış Ticaret Faaliyetleri Arasındaki İlişki: Sanayi İşletmeleri Örneği, İşletme Araştırmaları Dergisi (İAD), ISSN 1309-0712, DOI: 10.20491/isarder.2016.176.

Takım, A. Ve Ersungur, M. (2018), Türkiye'de Teşvik Sisteminin Yapısı, Sorunları Ve Etkinliği Üzerine Bir Politika Önerisi: Tek Bir Uygulamacı Kuruluş Sorunları Çözer Mi? Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, Cilt: 32 2018 Sayı: 3.

TOBB, Türkiye' de Kobi Tanımı <http://www.kobi.org.tr/index.php/tanimi/stats> (Erişim Tarihi:14.11.2108) .

TOBB, AB' de Kobi Tanımı <http://www.kobi.org.tr/index.php/tanimi/stats> (Erişim Tarihi:14.11.2108).

TOBB, Kobi İstatistikleri, <http://www.kobi.org.tr/index.php/tanimi/stats> (Erişim Tarihi:14.11.2108)

TOBB, Destek ve Teşvikler, <http://www.kobi.org.tr/index.php/tanimi/stats> (14.11.2108)

TOBB, Finansa Erişim, <http://www.kobi.org.tr/index.php/tanimi/stats> (14.11.2108)

TÜİK, Haber Bülteni-25.11.2016, Sayı 21540,
<http://www.tuik.gov.tr/PreHaberBultenleri.do?id=21540> (18.11.2018)

Türkiye İhracatçıları Meclisi (TİM), <http://www.tim.org.tr/tr/ihracat-yatirim-tesvikleri-eximbank-ihracat-kredileri.html> (Erişim Tarihi:14.11.2108).

Ulusoy, R ve Akarsu, R.(2012), Türkiye'de KOBİ'lere Yapılan Destekler ve İstihdam Üzerine Etkileri, Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi 23, 2012, 105- 126.

**DOĞRUDAN YABANCI YATIRIMLARIN ULUSLARARASI GİRİŞİMCİLİĞE KATKISI VE
ÖNEMİ**

Doç. Dr. Burak ÇAMURDAN*

ÖZET

Şirketler uluslararasılaşma sürecinde ilk etapta uluslararası ticaret ve daha sonra doğrudan yabancı yatırımlarla dış piyasalarda faaliyet göstermeye başlamışlardır. Doğrudan yabancı yatırım, bir firmanın başka bir ülkede yeni bir firma kurması, mevcut firmayı satın alması, onunla birleşmesi, o ülkedeki mevcut bir firmanın sermayesini artırarak ortaklık kurması yoluyla yapmış olduğu girişimleri kapsamaktadır.

Sermayenin liberalleşmesi sonucu uluslararası girişimcilik doğrudan yabancı yatırımlar (DYY) yoluyla, 1950'lerin sonlarına doğru, tüm dünyada, özellikle geçiş ekonomileri ve gelişmekte olan ülkelerde oldukça hız kazanmıştır. Uluslararası yatırımlar, firmaların/bireylerin ticaret ve girişimcilik açısından faaliyet alanlarını ciddi ölçüde genişletmektedir. Ancak, özellikle 2008 yılında yaşanan global finansal kriz gibi olumsuzlukların girişimcilerin uluslararası hareket kabiliyetlerinde daraltıcı etki yaptığı da diğer bir gerçekliktir. DYY her ne kadar sabit sermaye eksikliği yaşayan ekonomilerce önemle istenilse ve davet edilse de uyguladıkları çoğu bürokratik faktörler uluslararası girişimciler için önemli engeller oluşturmaktadır.

Bu çalışma ile uluslararası girişimciliğin DYY' dan ne denli etkilendiği, teşvik unsurlarının ve önündeki engellerin neler olduğu araştırılmakta ve engelleri ortadan kaldırmak için çözüm önerileri ortaya konulmaktadır. Çalışma içeriğinde DYY' nin ve Uluslararası Girişimciliğin teorideki tanımlarına ve tarihçelerine yer verilmektedir. Konu ile ilgili yapılan bilimsel araştırma sonuçları karşılaştırılarak DYY'ın Uluslararası Girişimciliğe katkı boyutu irdelenmektedir ve DYY'ın etki düzeyinin çok yüksek olduğu ve genel itibarıyla çok olumlu katkı gerçekleştiği sonucuna varılmıştır. DYY için uygulanan teşviklerin Uluslararası Girişimcilik açısından çok önemli motivatörler olması yanında yoğun ve katı bürokratik işlemlerin üstesinden gelebilme zorluğu ise caydırıcı temel unsur oluşturmaktadır. Bu negatif faktörler oluşturan işlemlerin yasa koyucular tarafından en aza indirilmesi ve kolaylaştırılması önerileri ise çalışmanın ortaya koyduğu diğer önemli sonuçlardır.

Anahtar Kelimeler: *Uluslararası Girişimcilik, Doğrudan Yabancı Yatırımlar, DYY' nin Uluslararası Girişimciliğe Katkıları, DYY için Teşvikler, Bürokratik Engeller*

Jel kodu: *F21, F23, M13*

* Pamukkale Üniversitesi, Honaz Meslek Yüksekokulu, Bankacılık ve Sigortacılık Bölümü, Menkul Kıymetler ve Sermaye Piyasaları Programı, Denizli-Türkiye, E-posta: bcamurdan@pau.edu.tr, Orcid No:0000-0002-4342-2946

**THE CONTRIBUTION OF FOREIGN DIRECT INVESTMENT TO INTERNATIONAL
ENTREPRENEURSHIP AND ITS' IMPORTANCE**

ABSTRACT

In the process of internationalization, companies started to operate in international markets and then in foreign markets through foreign direct investments. Foreign direct investment includes the initiatives of a firm to establish a new company in another country, to buy and join the existing company, to establish a partnership by increasing the capital of an existing company in that country. As a result of capital liberalization, international entrepreneurship gained momentum in the late 1950s through foreign direct investment (FDI), especially in transition economies and developing countries. International investments significantly expand the scope of activities of firms / individuals in terms of trade and entrepreneurship. However, negativities such as the global financial crisis experienced in 2008 caused a contractionary effect on the international mobility of entrepreneurs is the another fact. Although the FDI is strongly demanded by the economies that lack fixed capital and most of the bureaucratic factors they apply, they create important obstacles for these international entrepreneurs. With this study, it is investigated how the international entrepreneurship is affected by FDI, the incentives and the obstacles in front of them and the solutions are proposed to eliminate those obstacles. The study includes the definitions and histories of FDI and International Entrepreneurship in theory. By comparing the results of the scientific researches on the subject, the contribution dimension of DDY International Entrepreneurship is examined. It is concluded that FDI has a very high level of impact and is generally very positive. It was observed that the incentives applied for FDI were very important motivators for International Entrepreneurship, but the intensity and difficulty of bureaucratic procedures were the main deterrent. Another important result of the study is the suggestions of minimizing and facilitating these transactions by lawmakers.

Key Words: *International Entrepreneurship, Foreign Direct Investment, FDI International Contributions to Entrepreneurship, Incentives for FDI, Bureaucratic Barriers.*

Jel Codes: *F21, F23, M13*

1.GİRİŞ

Bu çalışmanın amacı, uluslararası girişimcilik hakkında açıklayıcı bilgilerde bulunmak ve uluslararası girişimciliği etkileyen faktörleri belirlemektir. Bu çalışma ile uluslararası girişimciliğin DYY' dan ne denli etkilendiği, teşvik unsurlarının ve önündeki engellerin neler olduğu araştırılmakta ve engelleri ortadan kaldırmak için çözüm önerileri ortaya koymaktır.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Çalışma içeriğinde DYY'nin ve Uluslararası Girişimciliğin teorideki tanımlarına ve tarihçelerine yer verilmektedir. Yöntem olarak konu ile ilgili olarak gerçekleştirilen bilimsel araştırmaların literatür taraması yapılmakta ve sonuçları karşılaştırılarak DYY Uluslararası Girişimciliğe katkı boyutu irdelenmektedir.

Günümüzde girişimcilik konusu, toplumun bütün katmanlarını her alanda kapsayan bir dönüşümü ifade eder hale gelmiştir. Artık girişimciliğin, rekabet, teknoloji ve bilişim alanlarında meydana gelen gelişmelere koşut olarak ülkelerin kalkınmasında büyük rol oynadığında şüphe yoktur. Son yıllarda gelişen küreselleşme kavramının bir sonucu olarak girişimcilik bundan böyle sadece ulusal alanda değil, uluslararası ticari ilişkilerin yaygınlaşmasının bir sonucu olarak uluslararası alanda da büyük öneme sahip bir kavram olarak karşımıza çıkmaktadır. Nitekim özellikle gelişmiş ülkelerdeki büyük işletmeler geliştirmekte olan veya az gelişmiş ülkelerdeki pazarlardan pay alabilmek için bakışlarını uluslararası sahalara çevirmişlerdir.

Ülkelerin birbirleriyle gerçekleştirdikleri mal ticaretinin yanında, son yıllarda uluslararası alanda hizmet ve telekomünikasyon sektörünün de büyük bir gelişme içinde olduğu görülmektedir. Gelişmekte olan ülkeler 1990'lı yıllara kadar yabancı yatırımlara şüpheyle yaklaşırlarken bugün artık yabancı yatırımları önemli bir gelişme aracı ve kurtarıcı olarak görmektedir. Bu bakımdan, özellikle doğrudan yabancı yatırımlar yoluyla, uluslararası girişimci faaliyetler dünya çapında büyük bir ivme kazanmıştır.

Şirketler uluslararasılaşma sürecinde ilk etapta uluslararası ticaret ve daha sonra doğrudan yabancı yatırımlarla dış piyasalarda faaliyet göstermeye başlamışlardır. Çok uluslu şirketler, liberal ekonomi sisteminin tüm dünyada kabul görmesiyle birlikte, yabancı yatırımların ve uluslararası girişimciliğin temellerini oluşturarak zaman içerisinde giderek güçlenmişler ve uluslararası ekonomik faaliyetlerin baş aktörleri haline gelmişlerdir. Dünyanın birçok ülkesinde yatırımları bulunan bu şirketlerin bazıları, üçüncü dünya devletlerinin bütçesinden daha büyük bütçelere sahip bulunmaktadır.

Uluslararası piyasalardaki bu faaliyet ve gelişmelere paralel olarak uluslararası boyutta anlaşmalar çerçevesinde ekonomik, sınai, ticari ve hukuki düzenlemeler yenilenmekte ve yeni uluslararası organizasyonlar oluşturulmaktadır (Kayıhan, 2008:119).

Sermayenin liberalleşmesi sonucu uluslararası girişimcilik doğrudan yabancı yatırımlar (DYY) yoluyla, 1950'lerin sonlarına doğru, tüm dünyada, özellikle geçiş ekonomileri ve geliştirmekte olan ülkelerde oldukça hız kazanmıştır. Uluslararası yatırımlar, firmaların/bireylerin ticaret ve girişimcilik açısından faaliyet alanlarını ciddi ölçüde genişletmektedir. Ancak, özellikle, 2008 yılındaki yaşanan global finansal kriz gibi olumsuzlukların girişimcilerin uluslararası hareket kabiliyetlerinde daraltıcı etki yaptığı da diğer bir gerçekliktir. DYY her ne kadar sabit sermaye eksiği yaşayan ekonomilerce önemle istenirse ve davet edilse de uyguladıkları çoğu bürokratik faktörler bu uluslararası girişimciler için önemli engeller oluşturmaktadır.

Küreselleşen dünyada, uluslararası girişimlerin vesile olduğu gelişime paralel olarak doğrudan yabancı yatırım yapılan ülke ekonomilerine güç kattığı anlaşılmıştır. Diğer taraftan, Dünya Bankası tarafından yapılan araştırmalar sonucunda, bir dizi bulgu, tedbir ve öngörü bürokratik faktörlerin uluslararası yatırımların ve girişimcilik faaliyetlerinin önünde çok önemli bariyerler oluşturduğunu ortaya koymuştur. Bu faktörler araştırmacılar tarafından çok önemsenmekte olup, politika yapıcıların bunları dikkate alarak, genişleyen faaliyet alanlarında ve dünya ölçeğinde, girişimciliğin önünü açmaya çalışmaları gereği vurgulanmaktadır.

Uluslararası girişimciliğin geliştirilmesi gayretleri aynı zamanda Dünya ticaret ve refah düzeyinin yükselmesine de hizmet etmektedir. Gelişmekte olan ülkelerde yaşanan iç tasarruf yetersizliği nedeniyle sermaye birikiminin finansmanı için kullanılan çok uluslu şirket kaynaklı doğrudan yabancı yatırımların kalkınma sürecine katkısının sağlanmasına çalışılması özellikle irdelenmesi gereken bir husus olarak görülmektedir. Bu konuda, kalkınma ve doğrudan yabancı yatırımlar arasında güçlü bir ilişkinin bulunduğu ve bu yatırımların gelişmekte olan ülkelere kalkınmanın en önemli ögesi olduğunu savunanlar bulunmaktadır. Ancak buna karşın, yabancı yatırımların hedef ülkenin ekonomik yapısını daha kötüleştirmekten öteye gidemediğini savunan muhalif görüşler de bulunmaktadır. Bu çerçevede, kalkınma perspektifinde, çokuluslu şirket girişimlerinin ve dolayısıyla doğrudan yabancı yatırımların gelişmekte olan ülke ekonomileri üzerinde olumlu ve olumsuz yönleri titizlikle ele alınmaktadır. Şu aşıkardır ki uluslararası girişimci sermayenin yapacağı doğrudan yabancı yatırımlara sağlanacak kolaylık, destek ve teşvikler o ülkelere yabancı yatırımcıları yöneltecek en değerli motivatörlerdir.

Doğrudan yabancı yatırımlar genellikle;

1. Bir firmanın başka bir ülkede yeni bir firma kurması,
2. Mevcut firmayı satın alması ve onunla birleşmesi,
3. Ev sahibi ülkedeki mevcut bir firmanın sermayesini artırarak onunla ortaklık kurması yoluyla yapmış olduğu girişimleri kapsamaktadır (YASED, Ekim 2014).

Doğrudan yabancı yatırımlar uluslararası iktisadi faaliyetlerde yatırım yapılan ülkelerin ekonomik kaynaklarıyla doğrudan ilişkili olmaktadır. Bu yatırımlar için ana iktisadi belirleyiciler üzerine bir çok ampirik çalışma gerçekleştirilmiştir. Bu araştırmalarla ortaya çıkan başlıca temel etmenler:

Piyasa büyüklüğü,

Dış ticaret açığı,

Faiz oranı,

Beşeri sermaye,

Enflasyon,

Büyüme

Dışa açıklık oranlarıdır.

Bu iktisadi unsurlar, uluslararası girişimcilerin kararlarını doğrudan ve en ziyade etkilemektedir (Ceviz ve Camurdan (2007).

Doğrudan yabancı yatırımların yatırım yapılan ülke ekonomilerine güç katması açısından özellikle globalleşme sürecinde çokuluslu şirketlerin faaliyetleri, yani uluslararası girişimciliğin önemi çok daha fazla artarak devam etmiştir. Elbette ve aynı zamanda uluslararası girişimcilik faaliyetleri neticesinde kazanç artırma fırsatları da girişimcilerin ulusal piyasalardan uluslararası piyasalarda yönelmelerine neden olmaktadır. Sadece girişimciler değil ülkeler de ya dış alım ya da dış satım yoluyla ekonomilerine pozitif ivme kazandırma gayretindedirler. Özellikle 2008 yılında yaşanan global finansal krizin hemen öncesi ve sonrasında çok hızlı yansıma yapan bu etmenler, girişimcilerin uluslararası hareket kabiliyetlerine her ne kadar daraltıcı yönde etki oluşturmuşsa da yabancı sermaye yatırımlarının, daha önce yaşanan krizler sonrası olduğu gibi, büyüme, gelişme ve kalkınma için kaçınılmaz olarak talep görmesi önemle hatırlarda tutulması gerekli bir olgudur.

2. LİTERATÜR TARAMASI

Zahra ve George (2002) göre “uluslararası girişimcilik” terimi ilk olarak Morrow'un (1988) kısa bir makalesinde ortaya çıkmıştır. Bundan kısa bir süre sonra, McDougall'ın (1989) yerel ve uluslararası yeni girişimleri karşılaştıran ampirik çalışması ile uluslararası girişimcilik alanında akademik çalışmaların yolunu açmıştır (Oviatt ve McDougall, 2005: 537).

Oviatt ve McDougall, 1997 yılında “ulusal sınırların ötesindeki iş örgütlerinde değer yaratma ve büyüme hedefine sahip yeni ve yenilikçi faaliyetler” olarak tanımladığı uluslararası girişimcilik tanımını “ulusal sınırları aşan ve işletmelerde değer yaratmayı amaçlayan yenilikçi, proaktif ve riskli davranışların birleşimi” şeklinde güncellemiştir (McDougall ve Oviatt, 2000: 903).

Zahra ve George (2002:11) uluslararası girişimciliği “rekabet avantajı arayışında olan bir firmanın, iç piyasalarının dışında yatan fırsatları yaratıcı bir şekilde keşfetme ve kullanma süreci” olarak tanımlamıştır. Uluslararası girişimciliği Çavuşgil ve Knight (2008: 69) “yenilikçi, küçük işletmelerin ulusal sınırlardan bağımsız dünyanın her yerinde işletmecilik fırsatlarını takip etmesidir” şeklinde tanımlamaktadırlar (Faiz ve Üner, 2015: 963).

Diğer bazı araştırma bulguları incelendiğinde, yurtdışı pazarlara dönük girişimciliğe dair yönelim ve davranışların, ihracat performansına olumlu etkisi olduğu ve uluslararasılaşma düzeyi yüksek işletmeler ile diğerleri arasında ihracat pazar performansı açısından anlamlı farklılık bulunduğu anlaşılmaktadır. İşletmelerin ihracat yapma süreleri arttıkça uluslararası girişimcilik yönelimleri de arttığı, ihracat pazar performansı ve uluslararası girişimcilik alt boyutları arasında çeşitli yön ve kuvvetlerde ilişki mevcuttur. Ayrıca, özellikle ihracata yeni başlayan işletmelerin uzun süre ihracat yapanlara göre daha fazla rakiplerle işbirliği yaptıkları ve daha fazla istekli oldukları görülmektedir.

Tayauova (2009), uluslararası girişimcilik yönelimi, çevre koşulları ve örgütsel unsurlar ile stratejik adaptasyon arasındaki ilişkileri araştırmak için Kırgızistan'da faaliyet gösteren Kırgız-Türk İşadamları Derneği'ne üye 56 Türk işletmesinden elde edilen verilere korelasyon ve regresyon analizlerini uygulamıştır. Yapılan korelasyon analizi sonuçlarından, uluslararası girişimcilik yönelimi ve örgütsel unsurlar ile stratejik adaptasyon arasında pozitif bir ilişki olduğu ortaya çıkmıştır. Çalışmada ayrıca, yenilikçilik, risk alma ve proaktiflik açısından atılanların uluslararası girişimcilik yöneliminin daha yüksek olduğu ortaya konulmuş, yapılan regresyon analizi sonucunda ise, bağımsız değişkenin uluslararası girişimcilik yöneliminin stratejik adaptasyondaki değişimi açıklayabildiği tespit edilmiştir.

Altuntaş vd. (2015), çalışmalarında Türkiye'deki ihracatçı işletmelerin uluslararası girişimciliği ile ihracat pazar performansları arasındaki ilişki olup olmadığını araştırmışlardır. Bu amacı gerçekleştirmek için 660 işletme örneklem olarak kabul edilmiş, 10 kişiden az veya 250 kişiden fazla eleman çalıştıran işletmeler ile yabancı ortaklı olan ve ihracata son bir yıl içinde başlayan işletmeler örneklemden çıkarılmış, sonuç olarak 437 ihracatçı işletmenin verisi çalışmada kullanılmıştır. Araştırma bulguları incelendiğinde, yurtdışı pazarlara dönük girişimciliğe dair yönelim ve davranışların, ihracat performansına olumlu etkisi olduğu ve uluslararasılaşma düzeyi yüksek işletmeler ile diğerleri arasında ihracat pazar performansı açısından anlamlı farklılık bulunduğu ortaya çıktığı anlaşılmaktadır.

Faiz ve Üner (2015) küresel işletmelerin uluslararası girişimcilik yöneliminin proaktif olmalarını etkileyen faktörleri tespit etmeyi amaçlamışlardır. Bu amacı gerçekleştirmek için araştırmacılar Sakarya ilinde farklı sektörlerde faaliyetlerde bulunan küresel işletmeleri tespit etmiş ve nitel araştırma yöntemi kullanılarak ilgili faktörlerin hangileri olduğu belirlenmeye çalışmışlardır. Küresel işletmelerin proaktif olmalarını etkileyen faktörler; fuarlar, bilgi, bilgi kaynakları, yönetici özellikleri, ağ bağlantıları ve güven olmak üzere altı başlık altında toplanmıştır.

Barclay ve Boston (2015) uluslararası girişimciliği etkileyen faktörler olarak, altyapıya ek olarak politik, yasal, ekonomik ve kültürel çevreler olarak sıralamıştır. Kurt ve Bilge (2016) çalışmalarında uluslararası girişimcilik faaliyetlerinin ihracat pazar performansına etkilerinin araştırmayı amaçlamışlardır. Bu amacı gerçekleştirmek için Manisa OSB'nde faaliyet gösteren firmaların dış ticaret departmanlarında çalışan kişilere 200 anket dağıtılmış, sağlıklı cevap veren 120 kişinin anketlerinden elde edilen cevaplar veri olarak kullanılmıştır. Araştırma sonucundan, işletmelerin ihracat yapma süreleri arttıkça uluslararası girişimcilik yönelimleri de arttığı, ihracat pazar performansı ve uluslararası girişimcilik alt boyutları arasında çeşitli yön ve kuvvetlerde ilişki olduğu bulguları elde edilmiştir. Çalışmadan ayrıca özellikle ihracat yeni başlayan işletmelerin uzun süredir ihracat yapanlara göre daha fazla rakiplerle işbirliği yaptıkları ve daha fazla istekli oldukları sonucuna da ulaşılmıştır.

Yalman ve Yalman (2018), çalışmalarında geçiş ekonomilerinde ticari serbestleşmeye paralel olarak gelişen uluslararası girişimcilik faaliyetlerinin mevcut durumu ortaya konarak, ülkelerin büyüme ve

kalkınmasındaki etkileri analiz etmişlerdir. Analizlerde, panel veri yöntemi kullanılmıştır, 2005-2016 yıllarına ait sağlıklı verilerin bulunabildiği 19 adet geçiş ülkesi ve 6 değişken ele alınmıştır. Çalışmada doğrudan yabancı yatırımlar ve iş kurma maliyetleri ile büyüme arasında karşılık nedensellik ilişkisi bulunmuştur. Bir başka ifade ile uluslararası girişimcilik faaliyetleri büyümeye sebep olmaktadır.

Reenu Kumari, Anil Kumar Sharma, (2017) panel data veri analizi yöntemiyle yapmış oldukları çalışmalarında gelişmekte olan ülkeler için yabancı sermaye yatırımlarının belirleyicileri olarak;

Piyasa büyüklüğü,

Dış ticaret açığı,

Faiz oranı

Beşeri sermayeyi tespit etmişlerdir.

Ayrıca, gelişmekte olan ülkelerde doğrudan yabancı yatırım (DYY) girişine ilişkin önemli katsayılar sağlayarak, piyasa büyüklüğü DYY girişinin en önemli belirleyicisi olarak ortaya çıkmaktadır. Bu tespit uluslararası girişimcilerin yurtdışı yatırımları açısından bir rehber niteliğindedir. Literatürde bu anlamda yapılan diğer birçok araştırma mevcuttur.

Cevis and Çamurdan (2007) çalışmalarında yurtdışı yatırımlarda girişimciler ve aynı zamanda yabancı sermaye ithal eden ülkeler açısından ana etmenleri bir panel data veri analizi ile irdelemişler ve sonuçta bu etmenleri;

1. Önceki dönem doğrudan yabancı yatırımlar (çekme faktörü),
2. GSYİH büyümesi (piyasa büyüklüğünü ölçer),
3. Ücret (birim işgücü maliyetleri),
4. Dış Ticaret Oranı (ülkelerin dışa açıklığını ölçer),
5. Reel faiz oranları (makroekonomik politikaları ölçer),
6. Enflasyon oranı (ülke riski ve makroekonomik politikaları gösterir) ve
7. Yurtiçi yatırımların boyutu ve potansiyeli(iş iklimini gösterir).

Bu 7 temel etmenin doğrudan yabancı sermaye girişlerini artırmada çok önemli rol oynadığı ve DYY girişlerinin daha ziyade ev sahibi ekonomilere güç verdiği yönünde bulgulara ulaşılmaktadır. Bu çalışmada enflasyon ve faiz oranları (makroekonomik politika belirleyicileri), ticaret oranları (dışa açıklık) ve büyüme (piyasaya bağlı ekonomik belirleyiciler aracılığıyla) tüm temel ekonomik DYY girişleri doğrudan etkiledikleri olarak ortaya çıkarken uluslararası girişimcilerin bu faktörlere göre hareket etmeleri ve fizibilite yapmaları gereği önemli bir sonuçtur.

Hoang ve Goujon tarafından yapılan ampirik çalışmalarla birlikte Bağli ve Adhikary (2014), Na ve Lightfoot (2006), Rogmans ve Ebberts (2013), Hubler ve Keller (2010), Asiedu (2002), Edwards (1990),

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

tarafından yapılan diğer çalışmalar DYY'nin herhangi bir ekonominin ticaret açıklığı ile pozitif ilişkili olduğu yönünde tespitleri içermektedir.

Diğer taraftan uluslararası girişimciliği etkileyen, bir ülkedeki yatırım ortamını belirleyen ve uluslararası girişimcilik kararlarına tesir eden makro ve mikro düzeyde etkenler vardır (AB Eşleştirme Projesi Raporu, 2006). Makro etkenler ayrıntılı olarak incelendiğinde bunları oluşturan önemli alt bileşenlerin olduğu görülmektedir (Yükseler, 2006:46).

Bu faktörler;

Vergiler,

Vergi yükü,

Maliyetler,

Yenilikçilik,

İş ortamı,

Altyapı,

Politik ortam,

Kamu yönetimi,

Belirsizlik,

Beklenen yatırım geri dönüş oranı,

Kültürel çevreler,

Proaktif davranma şeklinde sıralanabilmektedir.

Küresel işletmelerin girişimcilikte ve uluslararası faaliyet gösterme kararlarında proaktif olmalarına vesile olan faktörler ise;

Fuarlar,

Bilgi,

Bilgi kaynakları,

Yönetici özellikleri,

Ağ bağlantıları,

Güven olmak üzere altı başlık altında toplanabilmektedir.

Yatırım ortamını belirleyen makro unsurların yanında, özellikle iş ortamının temel belirleyicileri olan mikro unsurlar da söz konusudur. Dünya Bankası tarafından her yıl "İş Yapma Kolaylığı Raporu ve Endeksi" yayınlanmaktadır. Bu rapor ve endeks; şirket kuruluşu, dış ticaret süreçleri, kredi temini, vergi ödeme, icra- iflas ve inşaat izin süreçleri gibi birçok alanda şirketler açısından kolaylık sağlanan uygulamaların derecelendirildiği, uluslararası yatırımcılar tarafından yatırım kararının alınması aşamasında rehber olarak kabul edilen bir çalışmadır (YASED 2018). Dünya Bankası'nın İş Yapma Kolaylığı Endeksi'nde yer alan kriterleri iyileştiren ülkeler, yatırım çekme noktasında rekabet güçlerini

artırmaktadır. Dünya Bankası, ülkeleri “iş ortamı” açısından karşılaştırmak için sözü edilen unsurları da kullanmaktadır. Bu unsurlar aynı zamanda bir firmanın ticari veya sınai konulara ilişkin on alt bileşende yerine getirmesi gereken resmi formaliteleri ifade etmektedir (Soylu ve Çamurdan, 2008:184).. Bunlar;

- 1- Firma Kuruluş İşlemleri (Starting a Business)
- 2- Lisans ve İzin İşlemleri (Dealing with Licenses)
- 3- İşe Alma ve Çıkarma (Hiring and Firing)
- 4- Emlak Alım ve Kayıt (Registering Property)
- 5- Kredi Temini (Getting Credit)
- 6- Yatırımcı Koruması (Protecting Investors)
- 7- Vergi Ödeme İşlemleri (Paying Taxes)
- 8- Dış Ticaret İşlemleri (Trading Across Borders)
- 9- Ticari Sözleşme Yaptırım Gücü (Enforcing Contracts)
- 10- Firma İflası (Closing a Business) şeklinde belirtilmektedir.

İş ortamını elverişli hale getirmede yukarıda yer alan faktörler de oldukça belirleyici olabilmektedir ve önem taşımaktadır. Sonuçta gerek makro gerekse mikro yatırım faktörleri bir bütün oluşturmakta ve bu faktörlerin her birisi ayrı ayrı yatırım kararlarının ele alınmasında az ya da çok etkili olabilmektedir. Bu gerçeğin farkında olan birçok ülke yerli ve yabancı yatırımların önünü açabilmek için olağanüstü çaba göstermekte, birçok alanda reformlar gerçekleştirmektedir.

3.GENEL DEĞERLENDİRME VE SONUÇ

Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırımları, dünya üzerinde ekonomik büyüme hedeflerinin gerçekleştirilebilmesi için önemli bir araç olarak görülmektedir. DYY lar ev sahibi ülkelere sermaye birikiminin yanı sıra yeni teknoloji, yeni yönetim teknikleri, yeni işletme bilgisi, rekabeti geliştirme istihdam yaratma ve dünya pazarlarına yeni erişim kanalları gibi birçok imkânı da yanı sıra götürmektedirler (Aktan ve Vural, 2006). Uluslararası faaliyetler yoluyla ödemeler dengesi açıklarının kapatılmasına katkıda bulunur (Karabalık, 1998:1-3;Şahin, 2010:98). Uluslar bu avantajları yakalayabilmek için doğrudan yabancı sermaye yatırımlarını ülkelerine çekmek ve ülkelerinde kalmaları için yoğun çaba sarf etmektedirler. Bu amaçla hem hukuki güvence oluşturmak hem de çeşitli teşvikler sağlamak yönünde önemli yasal düzenlemeler yapılmaktadır (Kaya ve Kahreman, 2017:26). Gelişmekte olan ülkelerde yaşanan iç tasarruf yetersizliği ve sermaye birikiminin finansmanı için kullanılan çok uluslu şirket kaynaklı doğrudan yabancı yatırımların kalkınma sürecine katkısı özellikle irdelenmeye çalışılması gerekli bir husustur. Bu konuda, kalkınma ve doğrudan yabancı yatırımlar

arasında güçlü bir ilişkinin bulunduğu ve bu yatırımların gelişmekte olan ülkelerde kalkınmanın önemli ögesi olduğunu savunanlar kadar, bu yatırımların hedef ülkenin ekonomik yapısını daha kötüleştirmekten öteye gidemediğini ifade eden görüşler de bulunmaktadır. Bu çerçevede, kalkınma perspektifinde, çokuluslu şirket girişimlerinin ve dolayısıyla doğrudan yabancı yatırımların gelişmekte olan ülke ekonomileri üzerinde olumlu ve olumsuz yönleri değerlendirilmeye alınmaktadır ki bu gayretler o ülkelere yabancı yatırımcıları yöneltecek en değerli motivatörlerdir.

Literatür taramasından da izlenebildiği üzere uluslararası iktisadi faaliyetlerde yatırım yapılan ülkelerin ekonomik kaynaklarıyla doğrudan ilişkili olan:

Piyasa büyüklüğü,

Dış ticaret açığı,

Faiz oranı,

Beşeri sermaye,

Enflasyon,

Büyüme,

Dışa açıklık oranları ana iktisadi belirleyiciler olarak tespit edilmiştir.

Bu iktisadi unsurlar, uluslararası girişimcilerin kararlarını doğrudan ve en ziyade etkilemektedir. Gelişmekte olan ülkeler için yapılan araştırmalar sonuçlarından “piyasa büyüklüğü faktörünün” DYY girişimlerinde en önemli belirleyici olduğu kanaatini oluşturmaktadır. Ayrıca, bu tespit uluslararası girişimcilerin yurtdışı yatırımları açısından bir rehber niteliği taşımaktadır. Piyasa büyüklüğü her ne kadar DYY için en önemli motivatörlerden birisi olarak düşünülmekteyse de olmazsa olmaz unsur olarak Güven” faktörü değerlendirilmektedir.

Uluslararası girişimciliği etkileyen faktörler olarak;

1. Altyapı,
2. Politik,
3. Yasal,
4. Ekonomik,
5. Kültürel çevreler
6. Proaktif davranma gibi unsurlara yer verilebilmektedir.

Küresel işletmelerin proaktif olmalarına vesile olan faktörler ise;

1. Fuarlar,
2. Bilgi,
3. Bilgi kaynakları,
4. Yönetici özellikleri,

5. Ağ bağlantıları,
6. Güven olmak üzere altı başlık altında toplanabilmektedir.

DYY' in etki düzeyinin çok yüksek olduğu ve genel itibarıyla çok olumlu katkı gerçekleştiği sonucuna varılmıştır. Yurtdışı yatırımlarda DYY girişlerinin daha ziyade ev sahibi ekonomilere güç verdiği görülmektedir. Doğrudan yabancı yatırımların yatırım yapılan ülke ekonomilerine güç katması açısından özellikle globalleşme sürecinde çokuluslu şirketlerin faaliyetleri, yani uluslararası girişimciliğin önemi çok daha fazla artarak devam etmiştir.

Doğrudan yabancı yatırımlar ve iş kurma maliyetleri ile büyüme arasında karşılıklı, nedensellik ilişkisi bulunduğu tespit edilmiştir ve önemi ortaya konulmuştur. Çok uluslu şirketlerin DYY da çok önemli aktörler olduğu ve ekonomik ve yapısal güçleri sayesinde hem mikro hem de makro açılardan önemli kazanımlara vesile oldukları görülebilmektedir. Bir başka ifadeyle; uluslararası girişimcilik faaliyetleri makro ve mikro ekonomik büyümelere imkân tanımaktadır. Elbette ve aynı zamanda uluslararası girişimcilik faaliyetleri neticesinde kazanç artırma fırsatları girişimcilerin ulusal piyasalardan uluslararası piyasalarda yönelmelerine neden olmaktadır. Sadece girişimciler değil ülkeler de ya dış alım ya da dış satım yoluyla ekonomilerine pozitif ivme kazandırma gayretindedirler. Ortaya konan bu etmenler, özellikle 2008 yılında yaşanan global finansal kriz sonrasında, girişimcilerin uluslararası hareket kabiliyetlerini daraltıcı yönde etki oluşturmuşsa da daha önce yaşanan krizler sonrası olduğu gibi büyüme, gelişme ve kalkınma için yabancı sermaye yatırımlarının kaçınılmaz olarak talep görmesi özel bir önem arz etmektedir.

Diğer taraftan DYY için uygulanan teşviklerin Uluslararası Girişimcilik açısından çok önemli motivatörlerdir. Ancak, Dünya Bankası tarafından yapılan araştırmalar sonucunda ortaya konan bir dizi bulgu, tedbir ve öngörü arasında bürokratik faktörlerin uluslararası yatırım faaliyetleri açısından önemli olduğu ve çoğu kez de engelleyici konumda bulunduğu görülmektedir. Bürokratik işlemlerin yoğunluğu ve zorluk derecesi gerçekten caydırıcı temel unsur oluşturmaktadır. Bu engelleyici bürokratik faktörlerin yasa koyucular tarafından en aza indirilmesi ve kolaylaştırılması önerileri ise çalışmanın ortaya koyduğu diğer önemli sonuçtur. Bu faktörler çok önemsenmekte olup, politika yapıcıları bunları da dikkate alarak, dünya ölçeğinde genişleyen faaliyet alanlarında girişimciliğin önünü açabilecekleri gibi, dünya ticaret ve refah düzeyinin yükselmesine de hizmet etmiş olacaktırlar.

Çok uluslu şirketlerin ülke yönetimlerine müdahil olabilmeleri ise dikkate alınması gerekli diğer önemli bir husustur. Sonuç itibarıyla DYY ların özellikle ve daha ziyade çok uluslu şirketler yoluyla yapılabiliyor olması pozitif olduğu kadar negatif yönde de uluslararası girişimciliğe etki yapmaktadır.

KAYNAKÇA

AB Eşleştirme Projesi Raporu, Hazine Müsteşarlığı, 2006,
<http://www.hazine.gov.tr/filesys/twinning/hakkinda.pdf>, Ankara, 26.03.2008.

Aktan, C. C., Vural, İ., (2006) Çokuluslu Şirketler, Konya: Çizgi Kitabevi

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Altuntaş, G., Sözüer, A., ve Semerciöz, F. (2015) “Uluslararası Girişimcilik ile İhracat Pazar Performansı Arasındaki İlişki: Türkiye’deki İhracatçı İşletmeler Örneği”, Doğu Üniversitesi Dergisi, 16(1): 65-78.
- Asiedu (2002), “On the Determinants of Foreign Direct Investment to Developing Countries: Is Africa Different?”, World Development, 2002, 30 (1): 107-119.
- Bagli ve Adhikary (2014), “The Effect of Foreign Direct Investment on Economic Growth of Pakistan, Journal of Poverty”, Investment and Development www.iiste.org, ISSN 2422-846X An International Peer-reviewed Journal 14.
- Barclay, M.J., Boston, S. (2015). Factors Influencing International Entrepreneurship in the Hospitality Industry, Hospitality Education and Research Journal, 547.
- Cevis and Çamurdan (2007), The Economic Determinants of Foreign Direct Investment in Developing Countries and Transition Economies, The Pakistan Development Review, 46 : 3 (Autumn 2007) pp. 285–299
- Edwards (1990), Capital Flows, Foreign Direct Investment, and Debt-Equity Swaps in Developing Countries, NBER Working Paper No. 3497 (Also Reprint No. r1712) Issued in October 1990,
- Faiz, E., Üner, M.M. (2015). Uluslararası Girişimciliğin Proaktiflik Boyutu: Küresel Doğan İşletmeler Üzerine Nitel Bir Araştırma, Ankara Üniversitesi SBF Dergisi, 70(4), 957-981.
- Hoang ve Goujon (2014), Determinants of Foreign Direct Investment in Vietnamese Provinces: A Spatial Econometric Analysis, February 2014 Post Communist Economies 26 (1), DOI10.1080/14631377.2014.874658
- Hubler ve Keller (2010), Do Foreign Direct Investment and Trade lead to Lower Energy Intensity? Evidence from Selected African Countries, International Journal of Energy Economics and Policy, 2016, 6(1), 1-5.
- Karabalık H.(1998), Orta Avrupa Ülkelerinde Yabancı Sermaye Yatırımları ve Özelleştirme, Dış Ticaret Dergisi, Sayı:9, 1-6, Ankara
- Kaya, A., ve Kahreman, Y., (2017) Türkiye’de Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırımlarının Ekonomik Büyüme Etkisi, ETÜ, Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi (ETÜSBED),II/4,Sayfa: 25-39.
- Kayhan, Ş., (2008) Uluslararası Girişimciliğin Hukuki Görünümleri, 2. Uluslararası Girişimcilik Kongresi, Kırgızistan-Türkiye Manas Üniversitesi Yayınları: 112, Kongreler dizi:16.ss.116-127
- Kurt, İ., ve Bilge, H. (2016). Uluslararası Girişimcilik ve İhracat Performansı İlişkisi: Manisa Örneği, Journal of Human Sciences, 13(3), 4685-4696.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Lv Na, W.S. Lightfoot, (2006), Determinants of Foreign Direct Investment at the Regional Level in China, *Journal of Technology Management in China*, Vol. 1 Issue: 3, pp.262-278, <https://doi.org/10.1108/17468770610704930>
- Oviatt, B.M., P.P., McDougall (2000). International Entrepreneurship: The Intersection of Two Research Paths, *The Academy of Management Journal*, 43(5), 902-906.
- Oviatt, B.M., P.P., McDougall (2005). Defining International Entrepreneurship and Modeling the Speed of Internationalization, *Entrepreneurship Theory And Practice*, 537-553.
- Reenu Kumari, Anil Kumar Sharma, (2017) “Determinants of Foreign Direct Investment in Developing Countries: A Panel Data Study”, *International Journal of Emerging Markets*, 12 (4): 658-682, <https://doi.org/10.1108/IJoEM-10-2014-0169>
- Soylu, A., Çamurdan, B.,(2008) “Türkiye’deki Yatırım Ortamının Girişimciliğe Olan Etkileri Üzerine Bir Alan Araştırması (Denizli Örneği)”, 2. Uluslararası Girişimcilik Kongresi, Kırgızistan-Türkiye Manas Üniversitesi Yayınları: 112, Kongreler 16: 184-195
- Şahin, B.E., (2010), “Türkiye’de Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırımlarının Gelişimi”, *Finans Politik & Ekonomik Yorumlar*, 47 (550): 97-108.
- Tayauova, U. (2009) “Uluslararası Girişimcilik ve Stratejik Adaptasyon: Kırgızistan’da Faaliyet Gösteren Türk İşletmelerine Yönelik Bir Araştırma”, Doktora Tezi, İstanbul Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, İstanbul.
- Tim Rogmans, Haico Ebbers, (2013) “The Determinants of Foreign Direct Investment in The Middle East North Africa Region”, *International Journal Of Emerging Markets*, Vol. 8 Issue: 3, Pp.240-257, <https://doi.org/10.1108/17468801311330310>.
- WORLD BANK (2007), “Doing Business, How to Reform, The World Bank”, Washington DC.
- YASED (Ekim 2014), “Türkiye’nin Sürdürülebilir Kalkınmasında Uluslararası Doğrudan Yatırımların Katma Değeri”, <https://www.yased.org.tr/tr/haberler/yasedden-haberler>, 12032018.
- YASED Doing Business 2019, “Training for reform”, <https://www.yased.org.tr/tr/haberler/yasedden-haberler/yased-dunya-bankasi-is-yapma-kolayligi-endeksi> 16122018.
- Yükseler, Z., (2006) “Rekabet Gücü ve Yabancı Sermaye Yatırımları”, <http://www.tek.org.tr/dosyalar/2006,06.03.2008>.
- Zahra, S. A., ve George, G. (2002). “International Entrepreneurship: The Current Status Of The Field And Future Research Agenda”, In M. Hitt, R. Ireland, M. Camp, & D. Sexton (Eds.), *Strategic Leadership: Creating A New Mindset*, 255–288. London: Blackwell.

**TÜRKİYE' DE 2001-2018 YILLARI ARASI ÖDEMELER DENGESİ HESAP AÇIKLARI İLE
NET HATA NOKSAN HESABI İLİŞKİSİ ÜZERİNE GENEL BİR İNCELEME**

Doç. Dr. Burak ÇAMURDAN*

ÖZET

Ülkeler dış dünya ile yapmış oldukları mali işlemlerinden doğan yabancı para cinsinden giriş ve çıkışları “Ödemeler Bilançosu” denilen bir sistemde kayıt altında tutmaktadırlar. Türkiye' de ödemeler dengesi verileri, ana kalemler itibariyle, 1950-1974 yılları arasında Maliye Bakanlığı'nca oluşturulup yayımlanmakta iken, 1975 yılından bu yana Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası (TCMB) tarafından gerçekleştirilmektedir. Bu çalışma ile 2001-2018 yılları arasında Türkiye'de cari işlemler hesabında görülen açıklarla net hata ve noksan hesapları arasındaki ilişkisi üzerine bir değerlendirme yapılması amaçlanmıştır.

Zaman seri analizi yöntemi ile yapılan araştırma ve değerlendirmeler için oluşturulan veri seti özellikle TCMB, T.C Ticaret Bakanlığı ve konu üzerinde araştırmacıların eserlerinden derlenmiştir. Çalışma içeriğinde TCMB tarafından 1-Cari İşlemler Hesabı, 2- Sermaye Hesabı, 3- Finans Hesabı ve 4- Net Hata ve Noksan ana hesapları olmak üzere 4 ana bölüme ayrılmış olan hesaplar değerlendirilmeye alınmaktadır.

TCMB' in muhasebe esasları çerçevesinde tuttuğu bu hesaplarda pozitif ve negatif işaretli, bir başka ifadeyle, parasal giriş ve çıkışlardan oluşan rakamsal kayıtların bir dengede olması gerekmektedir. Ancak, bu her zaman mümkün olamamaktadır. Bu sebeple söz konusu bilanço aynı zamanda “Ödemeler Dengesi” şeklinde de isimlendirilmektedir. Denge dışına çıktığı durumlarda ise dengeden sapmanın hangi yönde olduğu önem taşımaktadır. Hesap dengelerindeki sapmalar eksik ya da fazla kayıt, kapsam, yeknesak olmayan fiyatlar, kayıt zamanları uyumsuzlukları, uygulamalarda tutarsızlıklar hata ve noksanlara yol açmaktadır. Net Hata ve Noksan işlem farklarının ve dolayısıyla bilanço dengesinin tutturulması maksadıyla kaydedilen tutarları kapsayan bölüm olarak değerlendirilmektedir. Bu kalemdeki hesaplamalar için, finans hesabı, cari işlemler hesabı ve sermaye hesabı kayıtları önem taşımaktadır. Serilerin analizi neticesinde Net Hata ve Noksanın 2001 sonrasında normal bir finansman kalemi haline gelerek cari işlemler açığının finansmanında önemli bir rol üstlenmiş olduğu görülmektedir.

* Pamukkale Üniversitesi, Honaz Meslek Yüksekokulu, Bankacılık ve Sigortacılık Bölümü, Menkul Kıymetler ve Sermaye Piyasaları Programı, Denizli-Türkiye, E-posta: bcamurdan@pau.edu.tr, Orcid No:0000-0002-4342-2946

İncelenen dönemde cari işlemler hesabında sürekli açık izlenmektedir ve en büyük açık tutarının ise 2011 yılında gerçekleştiği tespit edilmiştir. Buna paralel olarak 2011 yılındaki net hata noksan tutarının ise incelenen dönemin 3. büyük tutarı olduğu görülmüştür. Bu tutar söz konusu açığın %11' ni finanse etmektedir. Diğer taraftan dönemin en yüksek net hata noksan tutarı ise 2016 yılında oluşurken cari işlemler açığının %33' ü kadardır. 2016 yılı cari işlemler açığının geriye kalan kısmı ise doğrudan yatırım, portföy yatırımı, diğer yatırımlar ve rezervlerle finanse edilmektedir. Bunlar Çalışmanın en önemli sonuçlarıdır.

Anahtar Kelimeler: *Ödemeler Bilançosu, Net Hata ve Noksan Hesabı, Cari işlemler Açığı Zaman Seri Analizi, Ödemeler Dengesi Sermaye hesabı*

Jel kodu: *F30, F32, O16, O24, P45*

AN OVERALL REVIEW ON RELATIONSHIP BETWEEN

THE BALANCE OF PAYMENTS ACCOUNTS DEFICITS AND THE NET ERRORS AND OMISSIONS ACCOUNT IN TURKEY IN BETWEEN 2001 AND 2018

ABSTRACT

Countries record foreign inflows and outflows arising from their financial transactions with the outside world in a system called Balance of Payments. Turkey's balance of payments data, as the main items, between the years 1950-1974 while being created and published by the Ministry of Finance and since 1975, it is carried out by the Central Bank of Turkey (CBTR). In this study, it is aimed to make an assessment of the relationship seen in between the net errors and omissions account and the current account deficit in Turkey in between the years 2001-2018.

The data set for the research and evaluations carried out with the time series analysis method has been compiled especially from the works of the CBRT, the Ministry of Commerce and the studies of the researchers. Within the scope of the study, the accounts which are divided into four main sections by CBRT, as 1-Current Account, 2- Capital Account 3-Financial Account and 4- Net Error and omissions accounts, are taken into consideration. In these accounts, which are kept within the framework of the accounting principles of the CBRT, the numerical records consisting of positive and negative signs, i.e. monetary inputs and exits, should be in a balance. However, this is not always possible. Therefore, the balance sheet is also named as "Balance of Payments". In the case of out of equilibrium, the direction of deviation from the balance is important. Deviations in account balances result in incomplete or over-registration, coverage, uneven prices, record-time disputes, and inconsistencies in applications.

Net Errors and Omissions are considered as the part covering the amounts recorded for the purpose of balance of transactions and therefore balance of payments. For the calculations in this item, financial account, current account and capital account records are important. As a result of the analysis of the

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

series, it is seen that Net Error and Omissions has become a normal financing item after 2001 and played an important role in financing the current account deficit.

For the analyzed period, it is monitored that the deficit in the current account occurs in continuous and the biggest deficit amount was realized in 2011. Parallel to this, it is found out that the third largest amount of the Net Error and Omissions is in 2011 during the period examined. This amount finances 11% of the said deficit. On the other hand, the highest Net Error and Omissions amount of the period was in 2016 while it was 33% of the current account deficit. The remaining part of the current account deficit in 2016 is financed by direct investment, portfolio investment, other investments and reserves. These are the main findings of the study.

Key Words: *Balance of Payments, Net Errors and Omissions, Current Account Deficit, Time Series Analysis, Balance of Payments Capital account*

Jel Code: *F30, F32, O16, O24, P45*

1.GİRİŞ

Cari işlemler açığı, günümüzde ülke ekonomilerinin karşı karşıya olduğu önemli sorunlardan biri haline gelmiştir. Uzun yıllar boyunca ekonomi gündeminde hep yer almakta olan ve özellikle ülkemiz ekonomisi açısından önemi gün be gün artarak devam eden “Cari Açık” olgusu tüm ekonomi ile ilgili çevrelerce incelenmekte ve tartışmalara vesile olmaktadır. Cari Açık tabiri, günlük yaşamımızda yazılı ve görsel basın tarafından da sürekli gündeme getirilirken çoğu vatandaş sıklıkla duyduğu bu tabir hakkında hiçbir fikre sahip bulunmamaktadır. Bununla beraber, ekonomi bilimi ile ilgili olmakla birlikte konu hakkında derinlemesine bilgi edinme imkânı olmayan taraflarca da ülke ekonomisinin dış ticaretten dolayı yabancı para cinsinden kaybı veya zararı olarak algılanmakta ya da anlaşılmaktadır. Bu algı neticesinde, Cari Açık olgusu söz konusu taraflar için ekonominin tehlike sinyalleri verdiği ya da istenilmeyecek bir noktada olduğu anlamına gelmektedir. Kısaca, bir ülke, bir yıl içerisinde, yurt içi yerleşiklerce ihraç edilen mal, hizmet ve parasal olmayan altın ihracı kaynaklı gelirlerle birlikte, hiçbir karşı yükümlülük taşınmaksızın gelen paralar, faiz, temettü ve bireysel kazanç gibi transfer yoluyla gelen varlıklardan yabancı para cinsinden hesaplanan döviz sağlar. Diğer taraftan, aynı hususlar için yurt dışı yerleşiklere de ödemeler yapar. Eğer o ülke yurtiçi yerleşikler sayesinde elde etmiş olduğu dövizlerden daha fazlasını yurtdışı yerleşiklere ödediği takdirde ortaya çıkan negatif fark “Cari Açık” olarak ifade edilmektedir. Şayet yurtdışı yerleşiklere yapılan ödemeler elde edilenden daha az ise bu kez ortaya çıkan pozitif fark ise “Cari Fazla” olarak tanımlanmaktadır. Cari Açık olgusunun iyi anlaşılabilmesi için öncelikle “Ödemeler Dengesi (Bilançosu), Faiz Politikaları, Ulusal Para Değerlerinin Yabancı Paralar Karşısındaki Değerleme Kriter ve Yöntemleri, Devalüasyon, Revalüasyon (Döviz Kuru Politikaları), Uluslararası Ticaret (İthalat-İhracat), Yabancı Sermaye Akımları, Faiz ayarlamaları, Dış Ticaret Hadleri, Dış Borçlanmalar, Dış Ticaret Politikaları, Dış Açıklık, Liberasyon,

Enflasyon, Gayri Safi Yurtiçi Hâsıla (GSYİH), Ekonomik Büyüme, Kamuda Bütçe uygulamaları ve Dengesi, Açık ve Kapalı Ekonomi” gibi ekonominin temel hususlarıyla ilişkilendirilmesi ve etkileşimlerine dair bilgi ve görüş sahibi olunmalıdır (Çamurdan. 2013:73). Cari Açık ve Cari Fazla olgularını görebilmek ve hesaplayabilmek için yukarıda bahsedilen parametrelerden öncelikle “Ödemeler Bilançosu (Dengesi)” hakkında bilgi edinmek ve sistematüğini iyi kavramak gerekmektedir. Çünkü bu bilanço bir ülkenin dış dünyadan kazandığı döviz gelirlerini ve dış dünyada yaptığı döviz giderlerini bir denge yaklaşımı ile sergileyerek söz konusu dönem içinde ne kadar döviz açığı ya da döviz fazlası verdiğini ve eğer varsa bu açığı nasıl finanse ettiğini ortaya koyar (Eğilmez, 2006).

Cari işlemler hesabının yer aldığı Ödemeler Bilançosu/Dengesi ülkelerin dış dünya ile yapmış oldukları mali işlemlerinden doğan yabancı para cinsinden girişlerini ve çıkışlarını kayıt altında tuttukları sistemdir. Veri değerlendirmesi perspektifiyle tanımlandığında: Bir ekonomide yerleşik kişilerin diğer ekonomilerde yerleşik kişilerle (yurtdışında yerleşiklerle) belli bir dönem içinde yapmış oldukları ekonomik işlemlerin sistematik kayıtlarının yapıldığı istatistiki bir rapordur.

Türkiye' de ödemeler dengesi verileri, ana kalemler itibariyle, 1950-1974 yılları arasında Maliye Bakanlığı'nca oluşturulup yayımlanmıştır. 1975 yılından bu yana da Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası (TCMB) tarafından hazırlanmakta ve yayınlanmaktadır. 1975-1983 yılları için sadece ana kalemler itibariyle mevcut olan istatistikler, ayrıntılı sunum şeklinde, 1984-1991 yılları arasında yıllık olarak, 1992 yılı verilerinden itibaren ise aylık olarak TCMB İstatistik Genel Müdürlüğü, Ödemeler Dengesi Müdürlüğü'nce yayımlanmaktadır.

TCMB ödemeler bilançosunu, Uluslararası Para Fonu (IMF) tarafından üye ülkelere yol gösterici olarak hazırlanan “Ödemeler Dengesi ve Uluslararası Yatırım Pozisyonu 6. El Kitabı’ yer alan, uluslararası standartlara uygun olarak derlemektedir. IMF tarafından tasarlanan 6. El Kitabı, veri toplama, veri yayımlama ve diğer derleme süreçlerine ilişkin bir kılavuz niteliğinde değildir. Bu amaçlara yönelik olarak IMF'nin Ödemeler Dengesi Derleme Kılavuzu kullanılabilir. Söz konusu standartlar, ödemeler dengesi ve uluslararası yatırım pozisyonu istatistiklerinin tutarlılığını, karşılaştırılabilirliğini ve güvenilirliğini sağlamaktadır. 6. El Kitabı'nın amacı, ödemeler dengesi ve uluslararası yatırım pozisyonu istatistiklerinin gerekli alt bileşenlerini sağlamak ve açıklamak, aynı zamanda söz konusu istatistiklerin kullanımı hakkında temel düzeyde bilgi vererek, uluslararası karşılaştırılabilirliğini arttırmak üzere bir çerçeve oluşturmaktır. Ayrıca, ödemeler dengesi ve uluslararası yatırım pozisyonu istatistikleri ile diğer makroekonomik veriler arasındaki bağlantıların ortaya konulması ve farklı veri setleri arasındaki tutarlılığın sağlanması da hedeflenmektedir (TCMB, 2018:9)

2.LİTERATÜR TARAMASI

Büyüme ile ithalat ve ihracat nedensellik ilişkisini inceleyen çalışmaların çoğunda, ara ve yatırım malı ithalatlarının büyüme sürecini etkileyen başlıca unsurlar arasında olduğu görülmektedir (Yıldız ve

Berber, 2012). Literatürde gelişmiş ülkelerle az gelişmiş ülkeler arasındaki serbest dış ticaret ilişkilerinin az gelişmişliğe neden olduğu söz edilmektedir zira az gelişmiş ülkelerin sanayileşmesi için gerekli ara ve yatırım malları ithalatı, ihracat gelirleri ile karşılanmak durumundadır. Ancak, az gelişmiş ülkelerin ödemeler dengesi sürekli açık vererek bunun sürdürülmesine olanak tanımamaktadır. İthalat hacminin kısılması ekonomik büyümeyi olumsuz yönde etkileyeceğinden dolayı da az gelişmiş ülkelerin kalkınmaları ancak ve ancak minimum dış ticaret ilişkisinde buldukları dönemde gerçekleşebilecektir. İthalat ve büyüme ilişkisini test eden ampirik çalışmalara baktığımızda, ülkemizde ekonomik büyüme ihracat çekişli görünmektedir. Bununla birlikte gelişmekte olan ülkelerde ihracat yönlü ekonomik büyüme, Türkiye’de olduğu gibi ithalat bağımlı olmaktadır. Bu durumda, genelde ithalat ihracattan daha fazla artmakta ve ödemeler bilançosu dış ticaret hesabında ve cari işlemler dengesinde negatif etki yaratmaktadır (Çamurdan, 2013). Konuyla ilgili çeşitli çalışmalar için literatür taramalarında Cari Açık olgusuna neden olan etmenler için yapılan çok sayıda araştırma olduğu gözlenmiştir. Araştırmaların genelinde yukarıda söz edilen değişkenlerin hemen hemen hepsinin Cari Açık olgusu üzerinde etkili olduğu görülmektedir. Söz edilen değişkenlerin konvansiyonel yaklaşımlarda cari işlemlere etki eden ana belirleyiciler olduğu bilinmektedir. Döviz kurları, bütçe açıkları, iş rekabeti, özel tüketim amaçlı bireysel borçlanma istekliliği, dışa açıklık oranı, büyüme, dış ticaret dalgalanmaları, ihracatın ithalatı karşılama oranı, faiz farklılıkları bu kategoride sayılmaktadır. (Çeviş&Çamurdan, 2008) Hal böyle iken, ABD’li ekonomist ve FED başkanı, Ben Shalom Bernanke, (Bernanke, 2005) konvansiyonel görüşe alternatif görüş ileri sürerek ülkeleri Cari Açık olgusuna sürükleyen esas unsurun sermaye hesabı kaynaklı olduğunu belirtmektedir.

IMF eski başkanlarından Stanley Fisher’a göre "Bir ülkede yaklaşmakta olan krizin temel göstergesi cari işlem açığıdır. Gerçekleşen ve beklenen cari açık büyüksün veya ağır dış borç geri ödemesi yapan bir ülke yeterli cari işlem fazlası veremiyor ise, devalüasyona ve bunalıma davetiye çıkmış demektir (Fischer, 1988)".

Cari işlemler dengesi açıkları için risk sınırı belirlemesi de çok fazla tartışılan bir husustur. Risk sınırlamayı bir kenara bırakarak, özel kesimden kaynaklanan bir durumda, Cari Açığın yükselmesini iyi bir gelişme olarak gören ekonomi çevreleri bile bulunmaktadır. Diğer taraftan, dünyadaki bunalımlara da bakarak, özellikle borçlu ülkelerin bu konuda çok dikkatli olmasını ve açıklar için vakit yitirmeden önlemler almasını önerenler de az sayıda değildir. Genel kanı, Cari Açık GSYH’nin %5’ine ulaştığında, ekonomide kırmızı alarm geçilmesi gerektiği yönündedir (Freund, 2005). Buna sebep, cari işlemler dengesi açıklarının GSYH’nin %5 değerine ulaşması halinde, GSYİH büyüme hızı yavaşlamakta ve reel döviz kurunda önemli bir aşınma ortaya çıkmaktadır. Bir diğer görüş ise (Chen, 2011) den gelmiştir ve GSYİH büyüme oranı, cari işlemler dengesi açıklarının GSYH’ye oranından büyük olması halinde, cari işlemler dengesi açıkları sürdürülebilir niteliktedir.

Alagöz (2014) Net Hata Noksan hesabında yer alan tutarların kısa süreli sermaye girişi olarak adlandırabileceğini ve Türkiye’de, 2002 yılından sonra ekonomik büyümenin hızlanmasında bir neden olarak görmektedir. Yapmış olduğu ampirik çalışma sonucunda yüzde 10 anlamlılık düzeyinde net hata noksan hesabından ekonomik büyümeye doğru bir nedensellik ilişkisinin varlığının tespit edilmesinin de bunu görüşü desteklediğini söylemektedir.

(Çıplak, 2005) e göre Net Hata Noksan verileri analiz edilirken, öncelikle bazı hususların göz önünde bulundurulması gerekmektedir: - Sürekli aynı yönde Net Hata Noksan verilmesi, sistematik bir hatanın göstergesi olarak alınabilir. Herhangi bir dönemde Net Hata Noksan ’ın küçük olması, ölçüm hatası yapılmamış olmasını gerektirmez. Büyük pozitif ve negatif hataların birbirini götürmesi de olasılık dâhilindedir. Diğer taraftan, Net Hata Noksan birbirlerini izleyen dönemlerde birbirini götürme eğiliminde ise zamanlamadan kaynaklanan hatalardan söz edilebilmektedir. Net Hata Noksan kaleminin “esik” değerine ilişkin genel bir ölçüt, dış ticaret hacminin %5’i düzeyindedir. Net Hata Noksan bu düzeyi geçtiğinde ödemeler dengesi tablosunun doğruluğu konusunda kuşular gündeme gelmektedir.

Akat (2004), net hata-noksan hesabının cari açığın finansmanına katkı sağlamakla birlikte ülkenin dış borçlanma yükünü azalttığını ifade ederken; Yeldan (2005), cari açığın finansmanına katkı sağlayan bir sermaye olarak adlandırdığı net hata noksan hesabının, ödemeler bilançosunun finans hesabında gösterilmesi gereken bir yerli sıcak para olarak değerlendirmektedir. Bu yerli sıcak paranın spekülâtif nitelikli bir büyüme sürecini beraberinde getirerek, ülke ekonomisinde istikrarsızlık riskini artırma ihtimalini kuvvetlendirdiğine vurgu yapmaktadır. Yetkiner (2009) Net hata ve noksan hesabının cari açığın finansmanı ve ekonomik büyümede dönemlik pozitif katkı sağladığı görüşüne ulaştığını belirtmektedir. Bu durumun ülkede ekonomik faaliyetlerin kayıtlı durumdan kayıt dışına itildiğinin göstergesi olabileceğini ve ekonomik büyümenin önümüzdeki dönemde istikrarsızlığa götüreceğini savunmaktadır. Alagöz ve Savaş (2011), net hata noksan hesabının varlık nedeninin zaman, kapsam ve ölçüm hatalarına bağlamaktadır.

3.UYGULAMA VE YÖNTEM

Prensip itibarıyla, ödemeler bilançosunda bütün artı değerlerin toplamı ile bütün eksi değerlerin toplamının eşit bulunması (dengede olması =balans oluşturması), dolayısıyla bütün kayıtların net toplamının “0” değerinde olması gerekir. Ancak, uygulamada analitik veya istatistiksel nedenlerden dolayı ödemeler dengesi tablosunda, pozitif kayıtlar ile negatif kayıtlar eşit olmayabilmektedir ve Pozitif veya negatif değerli dengeden sapma oluşabilmektedir. Eksik ya da fazla (mükerrer) kayıt, kapsam, yeknesak olmayan fiyatlar, kayıt zamanları uyumsuzlukları, uygulamalarda tutarsızlıklar ödemeler dengesinde hata ve noksanlara yol açar. Ödemeler dengesi hesapları çift kayıt ilkesine göre derlendiği için alacak ve borç girişleri arasındaki fark ödemeler dengesi kayıtlarında Net Hata ve Noksan olarak ortaya çıkar. Bu durum, ödemeler dengesinde kaydedilmesi gereken bir takım verilerin eksikliğini, zamanlama

farklılığını veya kayıta hatayı ifade eder ki söz konusu değer ile oluşması gereken "0" değer arasında kalan tutar ayrı bir kalem olarak ters işaret ile Net Hata ve Noksan kalemine yansıtılarak düzeltme yapılır. Net hata ve noksan kalemi için standart bir miktar ya da orandan söz edilemez. Buna karşılık bu miktarın yüksekliği ve sürekli aynı yönde gelişiyor olması kayıtların, ölçümlerin, hesapların ve anketlerin doğru olmadığı yönünde kuşkuları artırır (Eğilmez, 2012).

TCMB tarafından tutulan kayıtlar son haliyle;

- ✓ Cari İşlemler Hesabı,
- ✓ Sermaye Hesabı,
- ✓ Finans Hesabı
- ✓ Net Hata ve Noksan ana hesapları olmak üzere 4 ana bölüme ayrılmış olan hesaplarla değerlendirilmeye alınmaktadır.

TCMB' in muhasebe esasları çerçevesinde tuttuğu bu hesaplarda pozitif ve negatif işaretli, bir başka ifadeyle, parasal giriş ve çıkışlardan oluşan rakamsal kayıtların bir dengede olması gerekmektedir. Ancak, bu her zaman mümkün olamamaktadır. Denge dışına çıkıldığı durumlarda dengeden sapmanın hangi yönde olduğu önem taşımaktadır.

Hesap dengelerindeki sapmalar:

- ✓ Eksik ya da fazla kayıt,
- ✓ Kapsam,
- ✓ Yeknesak olmayan fiyatlar,
- ✓ Kayıt zamanları uyumsuzlukları,
- ✓ Uygulamalarda tutarsızlıklar
- ✓ Kayıt dışlıklar
- ✓ Dış ticaret İşlemlerinde beyan yanlışlıkları,
- ✓ Anket ölçüm hataları nedenli hata ve noksanlara yol açmaktadır.

Ödemeler dengesi, toplamı sifıra eşit bir dengedir. Net Hata ve Noksan kayıtları, kaynağı belirlenemeyen döviz giriş veya çıkışlarını ifade eder. Dış dünyadan satın alınan mal ve hizmet tutarları ÖB' da gider yazılırken dış dünyaya satılan mal ve hizmet tutarları ise gelir olarak kaydedilir. Bu gelir ve giderin oluşturduğu dengeye de Cari Denge denilmektedir. Şayet Cari Denge hesabı kayıtları neticesinde negatif değerli bir tutar oluşmuşsa Cari Açık oluşmuş demektir. Cari Dengede açık oluştuğunda bu açığın karşılığı olarak:

- ✓ Borç,
- ✓ Sermaye girişi,
- ✓ Hisse senedi satışı,
- ✓ Tahvil, bono vb. yollarla gerçekleştirilen finansman tutarları dengeyi oluşturur.

İşte hesaplar arasında denge açısından bir tutarsızlık, bir fark varsa bu fark net hata ve noksan hesabına kaydedilir. Yani, işlem farklarının ve dolayısıyla bilanço dengesinin tutturulması maksadıyla kaydedilen tutarları kapsayan bölüm olarak “Net Hata ve Noksan” bölümü oluşturulmuştur ve söz edilen amaçla değerlendirilmektedir.

Bu kalemdeki hesaplamalar için,

- ✓ Finans hesabı,
- ✓ Cari işlemler hesabı
- ✓ Sermaye hesabı kayıtları önem taşımaktadır.

Net hata ve noksan kalemi kaynağı bilinmeyen bir döviz girişi veya çıkışı olduğu anlamına gelir. Bu durumu formüle ederek değerlendirecek olursak aşağıdaki denklemi yazabiliriz:

“Ödemeler Dengesi = Cari İşlemler Hesabı + Sermaye Hesabı + Finans Hesabı + Net Hata ve Noksan + Rezerv Varlıklar = 0 (Bu denklemdeki işaretler duruma göre eksi olabilir.)”.

Denklemde, Net Hata ve Noksan parametresinin “ \hat{O} =sıfır “olması halinde:

Net Hata ve Noksan ya (-) ya da (+) değer taşıyacaktır.

Şayet Net Hata ve Noksan (+) değer taşıyacakta ise ülkeye kaynağı bilinmeyen bir döviz girişi olduğu düşünülür. Eğer Net Hata ve Noksan (-) değer taşıyor ise bu kez ülkeden kaynağı bilinmeyen bir döviz çıkışı olduğu kanısına varılmaktadır.

Tablo 1. Türkiye'nin 2011 yılı Ödemeler Bilançosu Ana Hesap Rakamları üzerinden Net Hata Noksan Tutarı

| Ödemeler Dengesi (Milyon USD) | 2011 YILI | |
|--|----------------------|----------------|
| | Cari İşlemler Hesabı | -74.402 |
| Sermaye Hesabı | -25 | -25 |
| Finans Hesabı | 67.146 | |
| Net Hata ve Noksan | 8.295 | 8.295 |
| Genel Denge | 1.014 | |
| Rezerv Varlıklar | -1.014 | -1.014 |
| Finans Hesabı Dengeleme (Sıfıra Eşitleme) | | -67.146 |

Kaynak: TCMB ; <http://www.tcmb.gov.tr>

Tablodaki değerleri oluşturduğumuz denklemde yerine koyarak hesaplama yaptığımızda 2011 yılında Net Hata Noksan tutarı kadar; yani kaynağı bilinmeyen USD.8.295 milyar tutarında yabancı paranın Türkiye'ye giriş yaptığı kanaatine varılmaktadır.

$$(CİD+SH+FH+NH+RV= \hat{O}) \quad (1)$$

$$(-74.402-25+67.146+ 8.295-1,014=0) \quad (2)$$

Tablo 2. Türkiye'nin 2001-2017 dönemi Cari Denge ve Net Hata Noksan Tutarları

| Yıllar | Net Hata ve Noksan | Cari Denge |
|---------------|---------------------------|-------------------|
| 2001 | -2.127 | 3.760 |
| 2002 | -758 | -626 |
| 2003 | 4.489 | -7.554 |
| 2004 | 838 | -14.198 |
| 2005 | 1.495 | -20.980 |
| 2006 | -896 | -31.168 |
| 2007 | -315 | -36.949 |
| 2008 | 1.966 | -39.425 |
| 2009 | 2.314 | -11.358 |
| 2010 | -464 | -44.616 |
| 2011 | 8.295 | -74.402 |
| 2012 | -1.824 | -47.963 |
| 2013 | 1.041 | -63.642 |
| 2014 | 1.119 | -43.644 |
| 2015 | 9.756 | -32.109 |
| 2016 | 10.969 | -33.137 |
| 2017 | 759 | -47.357 |
| 2018 | | |

Kaynak: TCMB ; <http://www.tcmb.gov.tr>

4. GENEL DEĞERLENDİRME VE SONUÇ

Türkiye'de son yıllarda ödemeler dengesinde, net hata ve noksan hesabı kayıtlarında yüksek tutarlı, «+» değerler yer almaktadır. Net Hata ve Noksanın 2001 sonrasında normal bir finansman kalemi haline gelerek cari işlemler açığının finansmanında önemli bir rol üstlenmiş olduğu görülmektedir. İncelenen dönemde cari işlemler hesabında sürekli açık izlenmektedir ve en büyük açık tutarının ise 2011 yılında gerçekleştiği tespit edilmiştir. Buna paralel olarak 2011 yılındaki net hata noksan tutarının ise incelenen dönemin 3. büyük tutarı olduğu görülmektedir.

2011 yılındaki bu tutar söz konusu açığın %11 ni finanse etmektedir. Diğer taraftan dönemin en yüksek net hata noksan tutarı ise «10.969 milyar USD» ile 2016 yılında oluşmuş ve cari işlemler açığının %33' ü kadardır. 2016 yılı cari işlemler açığının geriye kalan kısmı ise;

- ✓ Doğrudan yatırım,
- ✓ Portföy yatırımı,
- ✓ Diğer yatırımlar ve
- ✓ Rezervlerle finanse edilmiştir.

2011 deki pik yapmış olan tutar hemen 2012 yılında «+» değerden «-» değere ve azalarak gerilerken 2013 yılı ile birlikte tekrar «+» değere ve sonrasında sürekli bir yükselme trendine girmiştir.

2015 ve 2016 yıllarında çok ani ve çok yüksek tutarlı Net Hata Noksan değerleri dikkat çekicidir. Ayrıca, 2014 yılındaki, « -43.644 milyar USD » tutardaki cari açık 2015 yılındaki NHN tutarına (+9,756 milyar USD) çok yakın bir tutarda azalma göstererek (-32.109 milyar USD) tutarına gerilemiştir ve NHN artışı ise anlamlı bir görüntü sergileyerek açığın adeta NHN ile birebir finanse edildiği izlenimi vermektedir. Tutarların yüksekliği basit bir takım hata ve eksiklerden daha farklı bir kayıt dışı döviz girişinin olduğu algısı oluşturmaktadır. Bununla birlikte veri setindeki yüksek olmayan, «-» NHN tutarları da zaman zaman parasal çıkışlar olduğu yorumuna vesile olabilmektedir.

KAYNAKÇA

Alagöz, M. (2014), Ekonomik Büyüme ve Net Hata-Noksan İlişkisi: Türkiye Üzerine Ekonometrik Bir Uygulama, Gaziantep University Journal of Social Sciences, 2014 13 (4):881-888, ISSN: 1303-0094.

Alagöz, M. Erdoğan, S. (2011). Net Hata Noksan Hesabının Anlamı ve Cari İşlemler İlişkisi: Türkiye Üzerine Ekonometrik Bir Uygulama. İktisat İşletme ve Finans. 26 (306): 69-94.

Bernanke, Ben S. (2005). The Global Saving Glut and the U.S. Current Account Deficit.<http://www.federalreserve.gov/boarddocs/speeches/2005/200503102> (11.09.2013).

Ceylan, R. ve Çeviş, İ. (2012), Enflasyon Hedeflemesi Rejimi Öncesi Ve Sonrasında Türkiye'de Cari Açıkların Sürdürülebilirliği., NWSA, e-Journal of New World Sciences Academy, 2012, Volume:7, Number:4, Article Number: 3C0101 ss.5

Chen, S. (2011a), Current Account Deficits and Sustainability: Evidence from the OECD Countries. Economic Modelling. Vol:28, pp:1455-1464.

Çamurdan, B. vd. (2009), The Interaction of The Current Account with its Determinants and The Effects of Inflation Targeting on Current Account Balance: The Case Of Turkey, e-Journal of New World Sciences Academy, Volume: 4, Number: 2, 154-169. pp. 2009 , DOI: 1308-7444.

Çamurdan, B. (2013) Türkiye'de Cari Açık Sorunu ve Sürdürülebilirliği Türkiye Ekonomisinde Güncel Ekonomik Ve Mali Konular, Bursa, Ekin Yayınevi

Çamurdan, B.(2013). Türkiye' de 1999-2013 Dönemi İçin İhracat, İthalat ve Ekonomik Büyüme Arasındaki Nedensellik İlişkisi. NWSA, e-Journal of New World Sciences Academy,

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Çeviş, İ.ve Çamurdan, B. (2008), The Determinants of the Current Account Balance in Inflation Targeting Countries, İktisat İşletme ve Finans, Cilt 23, Sayı 270 (Eylül), 111-131, DOI: 1300-610X.
- Çıplak, U. (2005), Ödemeler Dengesinde Net Hata Ve Noksan Kalemi Üzerine Bir Değerlendirme.,<http://www.tcmb.gov.tr/wps/wcm/connect/01c7bdcc-a979-4773-a4d4-3b68b7be530b/Net+Hata+ve+Noksan.pdf> (16.12.2018).
- Dura, C. (2013), Dış Açığın Asıl Sebebi Nedir?, <http://www.cihandura.com/ekonomi-yazilari/195-di-acigin-asil-sebeb-nedr.html> (12.09.2013).
- Eğilmez, M. (2006). Cari Açık Nedir?, <http://www.radikal.com.tr/haber.php?haberno=205170> , (14.09.2013).
- Eğilmez, M. (2012) “Net-Hata-ve-Noksan”. <http://www.mahfiyegilmez.com/2012/05/net-hata-ve-noksan.html> (10.09.2013).
- Fischer, Stanley (1988), “Real Balances, the Exchange Rate, and Indexation: Real Variables in Disinflation”, Quarterly Journal of Economics, 103 (1): 110-128.
- Freund, C.L. (2005), “Current Account Adjustments in Industrialized Countries”, Journal of International Money and Finance: 24(8): 1278-1298.
- Gerni, C. ve Diğerleri , (2006) “İthalata Dayalı İhracat ve Ekonomik Büyüme: 1980-2006 Türkiye Deneyimi”. 2. Ulusal İktisat Kongresi/20-22 Şubat 2008 / DEÜ İİBF İktisat Bölümü / İzmir – Türkiye.
- IMF, (1996) “Balance of Payment Text Book Companion Volume to: Balance of Payments Manual”, 5th ed. and Balance of Payments Compilation Guide. ISBN 1-55775-570-1
- Mann, C.L. (2002) “Perspectives on the US Current Account Deficit and Sustainability”, Journal of Economic Perspectives. 16(3): 131-152.
- Milesi-Feretti G.M. ve Razin, A. (1996) “Current Account Sustainability”, Princeton Studies in International Finance: No: 1, Princeton University, New-Jersey.
- Oktar, S. ve Dalyancı, L. ,(2012) “Dış Ticaret Hadlerinin Cari İşlemler Dengesi Üzerindeki Etkisi: Türkiye Örneği”, Marmara Üniversitesi İ.İ.B. Dergisi: Cilt: XXXIII, Sayı II, ss:1-18.
- Özçam. M. (2013) “Türkiye’de Cari Açık”, <http://www.ekonometrik.com/turkiyede-cari-acik.html> (18.09.2013).
- Taştan, H. ,(2010) “Türkiye’de İhracat, İthalat ve Ekonomik Büyüme Arasındaki Nedensellik İlişkilerinin Spektral Analizi”, Ekonomi Bilimleri Dergisi 2 (1), 2010 ISSN:1309-8020.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

TCMB, Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası Terimler Sözlüğü,
<http://www.tcmb.gov.tr/yeni/iletisimgm/sozluk.htm>, (08.09.2013).

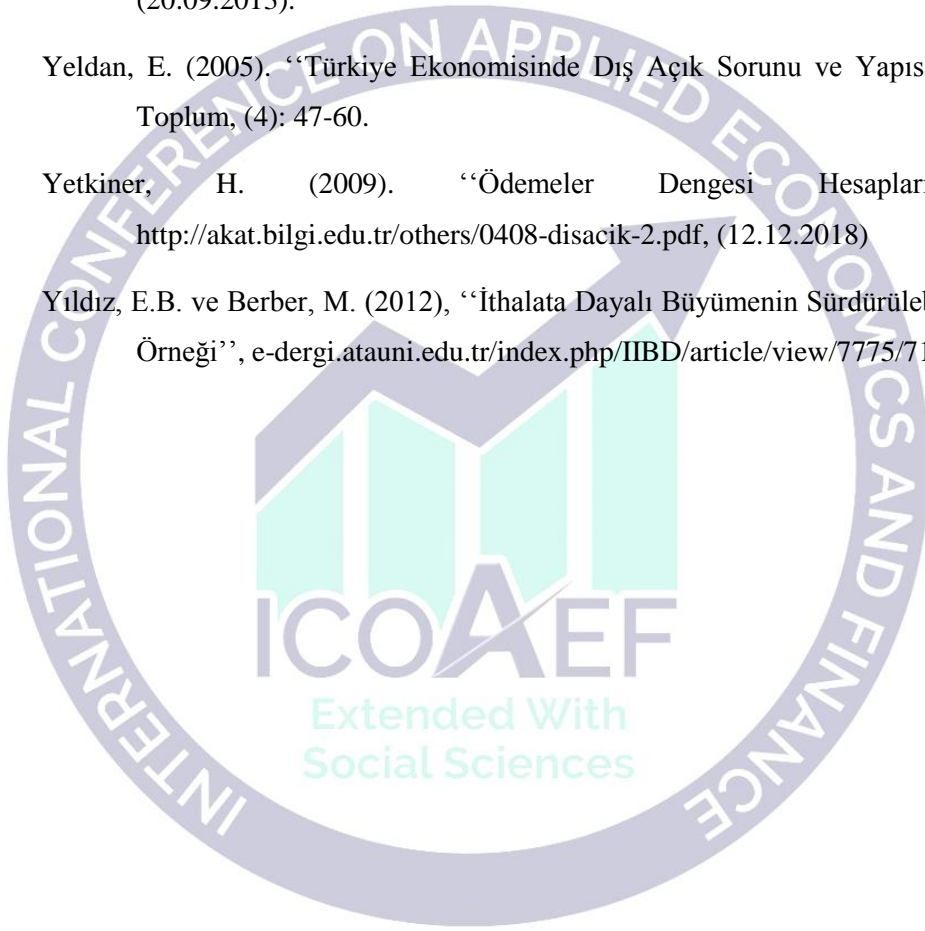
TCMB (2018), “Ödemeler Dengesi İstatistikleri ’ne İlişkin Yöntemsel Açıklama”,
<http://www.tcmb.gov.tr/wps/wcm/connect/TR/TCMB+TR/Main+Menu/Yayinlar>
(27.10.2018).

TEPAV, “Cari Açık Sorunu Artık Daha Tehlikeli”, <http://www.tepav.org.tr/tr/haberler/s/1942>
(20.09.2013).

Yeldan, E. (2005). “Türkiye Ekonomisinde Dış Açık Sorunu ve Yapısal Nedenleri,” Çalışma ve Toplum, (4): 47-60.

Yetkiner, H. (2009). “Ödemeler Dengesi Hesaplarında Ne oluyor?”,
<http://akat.bilgi.edu.tr/others/0408-disacik-2.pdf>, (12.12.2018)

Yıldız, E.B. ve Berber, M. (2012), “İthalata Dayalı Büyümenin Sürdürülebilirliği: 1989–2007 Türkiye Örneği”, e-dergi.atauni.edu.tr/index.php/IIBD/article/view/7775/7166



GÖÇ, TURİZM ve KAYITDIŞILIK

M. Kenan TERZİOĞLU*

Dilruba CAN**

İzlem DEĞİGOĞLU***

ÖZET

Sosyal adaletsizliğin giderek belirginleştiği küresel ekonomilerde insan hareketliliğinde artış gözlemlenmektedir. İnsan hareketliliğinin düzenlenmesi işgücü arzının düzenlenmesiyle yakından ilişkilidir. Ülkelerin ekonomik kalkınma politikalarında önemli bir sektör olarak ortaya çıkan turizm, toplumsal, sosyal, kültürel, siyasal ve çevresel gelişimde önemli rol oynamaktadır. İşgücü göçleri neticesinde toplam nüfus içinde ortaya çıkan göçmen nüfus sosyo-kültürel bir etki yaratarak uzun vadede turizm sektörü açısından da önemli bir rol oynamaktadır. Göçmenler, göç edilen ülke vatandaşlarıyla aynı haklara sahip olmadıkları için ikincil hatta üçüncül işgücü piyasaları oluşturmaktadır. Bu bağlamda, ulusal gelir hesaplarına kayıtlı olmayan ve gelir yaratıcı ekonomik faaliyetleri kapsayan kayıtdışı ekonomi, para ve maliye politikaları üzerinde etkili olmaktadır. Bu çalışmada, ekonomik, sosyal ve siyasal sebep ve sonuçlar doğrultusunda toplumsal yapıdaki değişimin göstergelerinden biri olan göç olgusu ile turizm ve kayıtdışılık arasındaki ilişki eşanlı panel veri analizi yöntemi kullanılarak araştırılmaktadır.

Anahtar Kelimeler: *Göç, Turizm, Kayıtdışı Ekonomi, İstihdam, Eşanlı Panel Veri Analizi*

MIGRATION, TOURISM AND INFORMALITY

ABSTRACT

An increase in human mobility is observed in global economies where social injustice is becoming more evident. The regulation of human mobility is closely related to the regulation of labor supply. Tourism that emerged as an important sector in economic development policies of countries plays an important role in social, cultural, political and environmental development. As a result of labor migration, the migrant population within the total population has a socio-cultural impact and plays an

* Doç.Dr., Trakya Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, Ekonometri Bölümü, Ekonometri Anabilim Dalı, kenanterzioglu@trakya.edu.tr

** Yüksek Lisans, Trakya Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Ekonometri Anabilim Dalı, dilrubacan39@hotmail.com

*** Yüksek Lisans, Trakya Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Ekonometri Anabilim Dalı, izlemde@gmail.com

important role in the long-term tourism sector. Since migrants do not have the same rights as the citizens of the country of migration, they form secondary and tertiary labor markets. In this context, informal economy which is not registered in national income accounts and includes income-generating economic activities has an effect on monetary and fiscal policies. In this study, the relation among tourism, informality and migration phenomenon which is one of the indicators of change in social structure in line with economic, social and political reasons and results is investigated by using simultaneous panel data analysis method.

Key Words: *Migration, tourism, informal economy, employment, simultaneous panel data analysis*

1.GİRİŞ

Ekonomik, sosyal, siyasal vb. zorunluluklar sonucunda ortaya çıkan yeni koşullara uyum sağlamak amacıyla kişinin yer değiştirmesi olarak tanımlanan göç, hem Avrupa Birliği (AB) hem de uluslararası açıdan ciddi bir problem olarak ortaya çıkmaktadır. Toplumsal hayatın önemli unsurlarından olan insan hareketliliğini ifade eden göç kavramı sınıflandırma, neden/sonuç ilişkisi ve tanımlanma açısından geniş bir yelpazeye sahiptir.

Potansiyel emek arzı kapasitesini gösteren ve üretim faktörlerinden birisini oluşturan işgücü, göç hareketliliğini belirleyen unsurlardandır. Emek piyasasındaki istihdam olanaklarının işgücü arzını karşılayamaması sonucunda oluşan göç hareketliliği, sosyal güvenceye sahip olmadan, göçmenlerin kayıtdışı sektörlerde ve marjinal işlerde istihdam edilimini ortaya çıkmaktadır. Kayıtdışı istihdam ise çalışanların çalışma durumlarını resmi kurum veya kuruluşuna hiç bildirilmemesi ya da eksik bildirilmesi durumunu ifade etmektedir. Bu durumda göçmenler hem yasal haklardan yoksun olarak çalışmakta hem de emeğin fiyatı düşürülerek emek piyasasında haksız rekabete yol açılmaktadır. Sosyal, kültürel ve ekonomik yapının farklı olması kayıtdışı istihdam kavramına ortak bir tanım yapılmasını güçleştirmekte ve bazı ekonomik faaliyetler bir ülkede yasadışı olarak kabul edilirken diğer ülkede yasal olarak değerlendirilebilmektedir.

Resmi olarak hesaplanan GSMH (Gayri Safi Milli Hasıla)'ya katkıda bulunacak ekonomik faaliyetlerin tümünü ifade eden kayıtdışı ekonomi hem gelişmiş hem de gelişmekte olan ülkeleri yakından ilgilendirmektedir (Thomas, 1999) . Portes vd. (1989) ve Loayza (1997), kayıtdışı ekonomik faaliyeti, benzerleri niteliğindeki faaliyetlerin düzenlendiği (kontrol edildiği) yasal ve sosyal bir çevrede, toplumun kurumları tarafından düzenlenmeyen faaliyetlerin bütünü olarak tanımlamaktadır. Smith (1994), kayıtdışı faaliyetleri ekonomik belirli davranışsal karakteristiklere göre tanımlamaktadır. Kayıtdışı ekonominin karakteristikleri, üyelerin kaçtığı belirli bir kurumsal kurallar kümesi tarafından belirlenmektedir (Feige, 1990). Kayıtdışı faaliyetleri teşvik eden ve kayıtdışı ekonomiyi genişleten faktörler arasında ülkelerin vergi sistemleri ve mali denetim eksiklikleri yer almaktadır. Daha fazla

gelire sahip olmak adına, ekonomik faaliyetlerinin tümü veya bir kısmı kayıtdışı tutulmakta ve bu faaliyetlerden elde edilen kazançlar üzerinden vergi ödenmemektedir. Kayıtdışı ekonomi, sosyal güvenlik ve vergi tabanını aşındırarak vergi tahsilatında bir azalışa neden olduğunda, bütçe açıklarında ve hem doğrudan hem de dolaylı vergilerde artışa neden olmaktadır. Artan vergilendirme ise sürekli büyüyen kayıtdışı ekonomi şeklinde kısır döngü yaratabilmektedir (Schneider, 2000).

Tanımsal ve davranışsal yaklaşımlar kayıtdışı ekonomiyi, uyuşturucu ticareti ve üretimi gibi yasadışı olarak üretilen mal ve hizmetleri kapsayan suç sektörü, yasal olarak üretilen ancak ilgili yasal kurumlardan gizlenen-vergi kaçırma gibi- mal ve hizmetler olarak tanımlanan kuralsız sektör; hane halkı üretimini içeren hane halkı sektörü ve düzenlenmemiş mikro teşebbüsler gibi yasanın avantajlarından yararlanamayan ancak maliyetlerinden de sakınabilen ekonomik faaliyetlerin bütünü olarak tanımlanan enformel sektör olmak üzere dört gruba ayırmaktadır (Fleming& Roman& Farrell, 2000). Adam ve Ginsburgh (1985), resmi ekonomi ile kayıtdışı ekonominin büyümesi ve belirli varsayımlar altında genişletici bir mali politikanın hem kayıtlı, hem de kayıtdışı ekonominin her ikisinde de pozitif bir ilişkiye sahip olduğu vurgulamaktadırlar. Ögünç ve Yılmaz (2000), artan kayıtdışı ekonomik faaliyetlerin, devletin vergi gelirlerini azaltabileceğini ve azalan vergi gelirlerinin de ekonomik büyümenin temel unsurlarından biri olan kamu alt yapı yatırımlarını azaltabileceğini ifade etmektedirler.

Ekonomik büyümenin gerçekleştiği ülkelerde istihdam edilenlerin sayısında artış olurken bazı durumlarda istihdam sağlanamamakta ve işsizliğin azalmasına katkı sağlayan kayıtdışı ekonomi ortaya çıkmaktadır. Kayıtdışı sistemde giriş ve çıkışların kolay olması ve kayıtlı sektörün yeterince istihdam yaratamaması neticesinde istihdam edilemeyenler kayıtdışı sektöre yönelmekte ve kayıtdışı ekonominin gelişmesini sağlamaktadır. Kayıtdışı ekonomi ile büyüme arasındaki ilişkinin yönünün negatif olduğu düşünülse bile pozitif etkisinin olduğuda varsayılmaktadır. Kayıtdışıdaki gelirlerin yarısından fazlasının kayıtlı sektörde harcanması ekonominin faal şekilde devamına ve doğrudan olmasa da vergilerin artışına katkı sağlamaktadır. Schneider ve Enste (2000), elde edilen kayıtdışı gelirlerinin büyük bir kısmının ekonomide harcanmasının pozitif bir değer göstergesine sahip olduğunu ifade etmektedir. Chen (2012), gelişmiş ülkelerdeki işsizlik ve eksik istihdamın ekonomik büyümeyle azaldığını, gelişmekte olan ülkelerde işsizlik ve eksik istihdamın ekonomik büyümeyle birlikte arttığını vurgulanmaktadır. Kızılot ve Çomaklı (2004), gelişmiş ülkelerde kayıtdışı ekonominin artmasıyla kayıtlı ekonominin büyümesi negatif etkilenmekteyken gelişmekte olan ülkelerde bu ilişkinin pozitif olduğunu ifade etmektedir. Schneider ve Klingmair (2004), gelişmekte olan ülkelere göre AB ülkelerinin kayıtdışı ekonominin GSYH'ya oranının yaklaşık iki katı kadar az olduğunu vurgulamaktadır.

Uluslararası bağlamda turist ve göçmen sayılarındaki artışla izlenen göç ve turizmdeki gelişmeler, her iki kavramın birbiriyle ilişkili olduğunu göstermektedir. Göçe dayalı turizm; gidilen ülkede kalıcı olmayan göçmenler tarafından ülkelere yaptıkları ziyaretlerle ortaya çıkan turizm faaliyetleri olarak

açıklanmaktadır. Farklı sosyo-kültürel yapıya sahip toplumların etkileşime geçerek ülkelerin değer yargılarının değişmesini etkileyen sosyal bir olay olan turizm ve göç ilişkisi çerçevesinde göç, hedef ülkelere önemli sosyal ve ekonomik katkılar sağlamakla beraber turizm ürünlerini ve göç alan ülkeyi kültürel açıdan zenginleştirmektedir (Barutçugil, 1989). Göç ve uluslararası ticaret turizmi teşvik ederken, turizm sektöründeki gerileme tersine göçe yol açtığından göç ve turizm birbirinin hem nedeni hem de sonucu olarak ortaya çıkmaktadır. Turizmin gelişmesi ile istihdam alanları yaratıldığından bölgeden göç azalmaktayken bölgeye göç artmakta ve ekolojik sistem bozulduğu için turizm etkilemektedir. Henderson ve Smith (2015), turistik bölgelerdeki altyapı gelişmeleri turist harcamalarını ve ekonominin canlanmasını doğrudan etkilemekle birlikte işçi göçünün oluşmasını sağlamaktadır.

İşgücü potansiyelini belirleyen faktörlerin başında işgücü miktarı ve nüfus oranı gelmektedir. Genellikle göçmenler hizmet sektöründe istihdam edilmektedir. İşgücü göçleri neticesinde toplam nüfus içinde ortaya çıkan göçmen nüfus, sosyo-kültürel bir etki yaratarak turizm sektörü açısından da önemli bir rol oynamaktadır. Turizm sektörü, istihdam yaratma politikasına öncelik vermek isteyen hükümetler için ideal alanlar arasında yer almaktadır. Turizm sektöründe istihdam talebi türetilmiş talep olmakta, turistik ürün ve hizmetlere talep olduğu sürece sektörde işgücü talebi olmaktadır (Tribe, 2004). Turizm sektöründe istihdam; turizm amaçlı kullanılacak tesislerin kurulumunda sağlanan istihdam ve bu ürünleri üretecek tesislerin sağladığı istihdam olarak ifade edilen dolaylı istihdam, turizmden elde edilen gelirin diğer sektörde yatırım haline dönüşmesini sağlayan uyarılmış istihdam ve turizm alanında faaliyet gösterten kamu kuruluşlarının sağladığı doğrudan istihdam şeklinde üçe ayrılabilir. Turizm faaliyetlerinin yoğunlaştığı dönemlerde işgücü talebi arttığında ve faaliyetlerin azaldığı dönemlerde ise işgücü talebi azaldığında turizm sektöründe genel olarak mevsimsel işçilerin çalıştırılması turizmde kayıtdışı çalışma oranlarında artışa sebep olmaktadır. Turizmdeki kayıtdışı istihdam sorunu mevsimsellikten kaynaklı olarak, denetimlerin zorlaştırılmasına neden olmakta ve kayıtdışı işçi çalıştıranların tespit edilmesini zorlaştırmaktadır. Şit (2016), turizm sektöründeki istidam etkisinin, turizmin gelişmesine ve turizm talebinin yoğunluğuna bağlı olduğunu ifade etmektedir. Kırsal bölgelerde göç eğiliminin kalkınmış bölgelere göre daha düşük olduğunu ve gelişmiş ülkeler için kırdan kente doğru olan hareketlerin artık temel göç hareketi olmadığını vurgulanmaktadır (Finnie, 2000). Göçün vasıflı mesleklerde bir etki yaratmazken vasıfsız mesleklerde ücret düzeylerini geriletirerek istihdamda artış yaratmaktadır (Camarota, 1997). Dustman& Fabbri& Preston& Wadsworth (2003), göçün istihdam üzerinde etkisi olmadığını vurgulamaktadır. Pischke ve Velling (1997), işsizlik ve göç arasındaki kesin bir ilişki varlığının bulunmadığını ifade etmektedir.

2.EŞANLI DENKLEM SİSTEMLERİ

Bağımlı değişken açıklayıcı değişkenler tarafından belirlenirken, açıklayıcı değişkenlerden bazıları da bağımlı değişken tarafından belirlenirse eşanlı ya da iki yönlü ilişkinin varlığından söz

edilebilmektedir (Gujarati,1995). Panel eşanlı denklemlerde, en önemli ekonometrik problem içsellik problemidir. Denklemlerin ayrı ayrı tahmin edilmesi sonucunda parametreler sapmalı sonuçlar vermektedir. Bu nedenle iki veya üç aşamalı en küçük kareler yöntemi gibi alternatif tahmin yöntemlerinin kullanılması önerilmektedir.

$Z_1 = [Y_1, X_1]$ ve $\delta'_1 = (\gamma'_1 \beta'_1)$ olmak üzere iki aşamalı en küçük kareler yöntemi için eşanlı denklem sistemi,

$$Y_1 = Z_1 \delta_1 + v_1 \quad (1)$$

şekindedir. Y_1 modelin içsel değişkenlerini ve X_1 modelin dışsal değişkenlerini ifade etmektedir. Tesadüfi etkiler tahmincisi, grup içi ve gruplar arası tahmincilerin ortalamalarından yararlanarak elde edilebildiğinden, eşanlı denklemin iki aşamalı en küçük kareler tesadüfi etkiler tahmincisi elde edilebileceğinden $Z_\mu = (I_N \otimes I_T)$, $\mu'_1 = (\mu_{11}, \dots, \mu_{N1})$ ve $u'_1 = (u_{11}, \dots, u_{NT1})$ olmak üzere hata bileşenleri modeli,

$$v_1 = Z_\mu \mu_1 + u_1$$

şeklinde yazılabilmektedir. Tesadüfi etkiler modelinin tahmini için (1) numaralı eşitlik, $P = (I_N \otimes \bar{J}_T)$ olmak üzere, $Q = I_{NT} - P$ ile çarpılarak grup içi dönüşümler yapılmaktadır.

$$\begin{aligned} QY_1 &= QZ_1 \delta_1 + Qv_1 \\ \tilde{y}_1 &= \tilde{Z}_1 \delta_1 + \tilde{v}_1 \end{aligned} \quad (2)$$

şeklinde elde edilen modele iki aşamalı en küçük kareler uygulandığında

$$\tilde{\delta}_{1,Gi2AEKK} = (\tilde{Z}'_1 P_{\tilde{x}} \tilde{Z}_1)^{-1} \tilde{Z}'_1 P_{\tilde{x}} \tilde{y}_1 \quad (3)$$

şeklinde grup içi iki aşamalı en küçük kareler tahmincisi elde edilmektedir.

$\hat{\sigma}_{u_{11}} = (Y_1 - Z_1 \tilde{\delta}_{1,Gi2AEKK})' Q (Y_1 - Z_1 \tilde{\delta}_{1,Gi2AEKK})$ olmak üzere varyans

$$var(\tilde{\delta}_{1,Gi2AEKK}) = \sigma_{u_{11}}^2 (\tilde{Z}'_1 P_{\tilde{x}} \tilde{Z}_1)^{-1} \quad (4)$$

olarak hesaplanabilmektedir. (1) numaralı eşitlik P ile çarpılarak gruplar arası dönüşüm yapıldığında

$$\begin{aligned} PY_1 &= PZ_1 \delta_1 + Pv_1 \\ \bar{y}_1 &= \bar{Z}_1 \delta_1 + \bar{v}_1 \end{aligned} \quad (5)$$

gruplar arası iki aşamalı en küçük kareler tahmincisi

$$\hat{\delta}_{1,GA2AEKK} = (\bar{Z}'_1 P_{\bar{X}} \bar{Z}_1)^{-1} \bar{Z}'_1 P_{\bar{X}} \bar{y}_1 \quad (6)$$

şeklinde gösterilmektedir. $\tilde{\sigma}_{1_{11}}^2 = (Y_1 - Z_1 \tilde{\delta}_{1,GA2AEKK})' P (Y_1 - Z_1 \tilde{\delta}_{1,GA2AEKK})$ ve $\sigma_{1_{11}}^2 = T \sigma_{\mu_{11}}^2 + \sigma_{u_{11}}^2$ olmak üzere varyans

$$var(\tilde{\delta}_{1,GA2AEKK}) = \sigma_{1_{11}}^2 (\bar{Z}'_1 P_{\bar{X}} \bar{Z}_1)^{-1} \quad (7)$$

şeklinde hesaplanabilmektedir. Üçüncü aşamada, iki dönüştürülmüş eşitlik bir sistem olarak düşünülmekte ve $E \begin{pmatrix} \tilde{X}' \tilde{v}_1 \\ \bar{X}' \bar{v}_1 \end{pmatrix} = 0$ ve $var \begin{pmatrix} \tilde{X}' \tilde{v}_1 \\ \bar{X}' \bar{v}_1 \end{pmatrix} = \begin{bmatrix} \sigma_{u_{11}} \tilde{X}' \tilde{X} & 0 \\ 0 & \sigma_{u_{11}} \bar{X}' \bar{X} \end{bmatrix}$ olmak üzere

$$\begin{pmatrix} \tilde{X}' \tilde{y}_1 \\ \bar{X}' \bar{y}_1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \tilde{X}' \tilde{Z}_1 \\ \bar{X}' \bar{Z}_1 \end{pmatrix} \delta_1 + \begin{pmatrix} \tilde{X}' \tilde{v}_1 \\ \bar{X}' \bar{v}_1 \end{pmatrix} \quad (8)$$

Eşitliğine genelleştirilmiş en küçük kareler uygulandığında

$$\hat{\delta}_{1,TE2AEKK} = \left[\frac{\tilde{Z}'_1 P_{\tilde{X}} \tilde{Z}_1}{\sigma_{u_{11}}} + \frac{\bar{Z}'_1 P_{\bar{X}} \bar{Z}_1}{\sigma_{1_{11}}} \right]^{-1} \left[\frac{\tilde{Z}'_1 P_{\tilde{X}} \tilde{y}_1}{\sigma_{u_{11}}} + \frac{\bar{Z}'_1 P_{\bar{X}} \bar{y}_1}{\sigma_{1_{11}}} \right] \quad (9)$$

tesadüfi etkiler iki aşamalı en küçük kareler tahmincisi

$$var(\hat{\delta}_{1,TE2AEKK}) = \left[\frac{\tilde{Z}'_1 P_{\tilde{X}} \tilde{Z}_1}{\sigma_{u_{11}}} + \frac{\bar{Z}'_1 P_{\bar{X}} \bar{Z}_1}{\sigma_{1_{11}}} \right]^{-1}$$

elde edilmektedir. $Y' = (Y'_1, \dots, Y'_M)$, $Z = diag[Z_j]$, $\delta' = (\delta'_1, \dots, \delta'_M)$, $v' = (v'_1, \dots, v'_M)$ ve $Z_j = [Y_j, X_j]$ olmak üzere

$$Y = Z\delta + v \quad (10)$$

ele alındığında j. eşitliğin kalıntısı

$$v_j = Z_\mu \mu_j + u_j$$

iken varyans-kovaryans matrisi

$$\Omega_{j1} = E(v_j v'_1) = \sigma_{\mu_{jl}}^2 (I_N \otimes J_T) + \sigma_{u_{jl}}^2 (I_N \otimes J_T) \quad (11)$$

şeklinde gösterilmektedir. (11) numaralı sistem eşitliği için varyans-kovaryans matrisi,

$$\Omega = E(vv') = \Sigma_\mu \otimes (I_N \otimes J_T) + \Sigma_u \otimes (I_N \otimes I_T)$$

olarak hesaplanmaktadır. Sistem tahmininde (11) eşitliği $(I_M \otimes Q)$ ile çarpılıp grup içi dönüşüm yapıldığında,

$$\tilde{y} = \tilde{z}\delta + \tilde{v} \quad (12)$$

eşitliğine üç aşamalı en küçük kareler uygulandığında, $\tilde{X} = PX$ olmak üzere

$$\hat{\delta}_{G13AEKK} = [(\tilde{Z}'\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}})\tilde{Z}]^{-1}[(\tilde{Z}'\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}})\tilde{y}] \quad (13)$$

şeklinde grup içi üç aşamalı EKK tahmin edicisi elde edilmektedir. (11) eşitliği ile $(I_M \otimes P)$ çarpılıp gruplar arası dönüşüm yapıldığında

$$\bar{y} = \bar{Z}\delta + \bar{v} \quad (14)$$

elde edilmekte ve üç aşamalı EKK uygulanarak

$$\tilde{\delta}_{G13AEKK} = [(\bar{Z}'\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}})\bar{Z}]^{-1}[(\bar{Z}'\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}})\bar{y}] \quad (15)$$

gruplar arası üç aşamalı en küçük kareler tahmincisine ulaşılmaktadır. (13) ve (14) eşitliği sırasıyla $(I_M \otimes \tilde{X}')$ ve $(I_M \otimes \bar{X}')$ ile çarpılıp bir sistem olarak genelleştirilmiş en küçük kareler uygulandığında

$$\tilde{\delta}_{1,TE3AEKK} = [\tilde{Z}'(\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}})\tilde{Z} + \bar{Z}'(\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}})\bar{Z}]^{-1} * [\tilde{Z}'(\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}})\tilde{y} + \bar{Z}'(\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}})\bar{y}] \quad (16)$$

tesadüfi etkiler üç aşamalı EKK tahmincisi elde edilmektedir. $y^* = \Omega^{-1/2}Y$, $Z^* = \Omega^{-1/2}Z$ ve $v^* = \Omega^{-1/2}v$ olmak üzere, (11) eşitliği $\Omega_{11}^{-1/2}$ ile çarpılıp,

$$y^* = Z^*\delta_1 + v^* \quad (17)$$

elde edilmekte ve üç aşamalı EKK tahmincisi,

$$\tilde{\delta}_{3AEKK} = (Z^{*'}P_A Z^*)^{-1}Z^{*'}P_A y^* \quad (18)$$

olarak gösterilmektedir(Tatoğlu,2012).

3.GÖÇ, TURİZM ve KAYITDIŞI ETKİLEŞİMİ

Çalışma kapsamında 2003-2015 dönem aralığında 12 AB²⁵ ülkesi ile Türkiye²⁶ arasında panel eşanlı denklem modellemesi kullanılarak göç, turizm ve kayıtdışılık ilişkisinin ortaya çıkarılması amaçlanmaktadır. Göç değişkeni olarak belirli bir alanın aldığı göç ile verdiği göç arasındaki fark, turizm değişkeni olarak uluslararası taşımacılık için ulusal taşıyıcılara yapılan ödemeler dahil olmak üzere uluslararası gelen ziyaretçiler tarafından yapılan harcamaları ifade eden turizm gelirleri, ve

²⁵ Avusturya [AUT], Belçika [BEL], Fransa [FRA], Almanya [DEU], İrlanda [IRL], İtalya [ITA], Hollanda [NLD], İspanya [ESP], İsveç [SWE], Birleşik Krallık[GBR], Çek Cumhuriyeti [CZE], Danimarka [DNK]

²⁶ Türkiye [TUR]

kayıtdışı değişkeni olarak kayıtdışılığın gayri safi yurt içi hasılaya oranı alınmaktadır. Çalışma kapsamında, değişkenler arasındaki etkileşimin daha iyi ortaya çıkarılması için göç [G], turizm [T] ve kayıtdışı [K] değişkenleriyle ilişkili olan istihdam [İ], vergi gelirleri [VG] ve kamu harcamaları [KH] değişkenleri de model yapısına dahil edilmektedir. Kullanılan veri setlerine Central Intelligence Agency(CIA), OECD ve Dünya Bankası'ndan ulaşılabilmektedir. İlgili değişkenlerin logaritmik birinci sıra farkları alınarak 100 ile çarpılması sonucunda yüzde değişimler elde edilmektedir.

Ekonometrik analizler yapılmadan önce serilerin zaman içerisinde sabit olup olmadığı incelenmeli ve sonuçların sapmalı ve yanıltıcı olmaması için durağanlığın test edilmesi gerekmektedir. Panel birim kök testleri birinci ve ikinci kuşak testler olmak üzere ikiye ayrılmaktadır. Birinci kuşak testler homojen ve heterojen modeller olmak üzere kendi içinde ikiye ayrılmaktadır. İkinci kuşak birim kök testler, yatay kesit birimleri arasındaki yatay kesit bağımlılığını göz önünde bulundurmaktadır. Bu çalışmada birinci kuşak testlerinden Levin, Lin ve Chu, Breitung, Im, Pesaran ve Shin, Hadri LM, Harris-Tzavalis, Fisher PP ve Fisher ADF testleri ile ikinci kuşak testlerinden Pesaran's CADF testi kullanılmaktadır.

Tablo 4. Panel Birim Kök Test Sonuçları

| | G | K | T | İ | VG | KH |
|---------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | I(0) | I(0) | I(0) | I(0) | I(0) | I(0) |
| Levin, Lin ve Chu | -0.0065** | -8.66788** | -10.7484** | -2.22963** | -9.34076** | -8.59664** |
| Harris ve Tzavalis | -1.32613** | -0.22191** | -11.8307** | -1.36708** | -5.23354** | -8.9492** |
| Breitung | -1.25151** | 2.5701** | -8.8959** | -4.15363** | -1.98679** | -5.71376** |
| Hadri | 3.06683** | 8.26722** | -1.44833** | 3.27847** | 11.0006** | 1.94207** |
| Im, Pesaran ve Shin | -0.0065** | -3.93198** | -6.46126** | -8.82323** | -4.40258** | -5.02476** |
| Fisher PP | | | | | | |
| Inverse X^2 | 4.43755** | 1.41297** | 9.06087** | 9.89872** | 10.60254** | 6.8224** |
| Inverse normal | -5.02242** | 1.74863** | -6.38105** | -11.3095** | -3.14392** | -5.3196** |
| Inverse logit | -11.2408** | 1.5548** | -6.50364** | -4.00595** | -5.79501** | -5.2507** |
| Modified inv. X^2 | -5.22249** | -0.88569** | 7.74657** | 3.03134** | 9.76313** | 5.8136** |
| Fisher ADF | | | | | | |
| Inverse X^2 | 1.31716** | 7.5374** | 3.7375** | 6.42083** | 4.19562** | 4.01895** |
| Inverse normal | 3.65625** | -3.20775** | -0.77714** | -1.39997** | -0.17238** | -3.06228** |
| Inverse logit | 3.96578** | -10.0727** | -0.86008** | -1.7745** | -0.68029** | -2.94229** |
| Modified inv. X^2 | -0.89895** | 8.59521** | 0.51831** | 3.23401** | 1.84379** | 2.36015** |

(***, **, * sırasıyla 0.01, 0.05 ve 0.10 düzeyinde anlamlılığı göstermektedir.)

Tablo 1.'de Levin, Lin ve Chu, Breitung, Im, Pesaran ve Shin, Hadri LM, Harris- Tzavalis ve Fisher birinci kuşak panel birim kök testleri ve Pesaran's CADF ikinci kuşak panel birim kök test sonuçlarına göre; göç, turizm, kayıtdışı, istihdam, vergi gelirleri ve kamu harcamaları değişkenlerinde birim kök bulunmadığından serilerin durağan olduğu gözlemlenmektedir. Tutarlı tahminçiler elde edilebilmek için çalışmada, içselliği göz ardı etmeyen, üç aşamalı en küçük kareler tahmin yöntemi kullanılmaktadır.

Göç, turizm ve kayıtdışı, istihdam, vergi gelirleri ve kamu harcamaları değişkenleri arasındaki ilişkinin ortaya çıkarılması için eşanlı panel modeli,

$$\begin{aligned}G_{it} &= \beta_{11}K_{it} + \beta_{12}T_{it} + \beta_{13}I_{it} + u_{1it} \\K_{it} &= \beta_{21}T_{it} + \beta_{22}G_{it} + \beta_{24}VG_{it} + u_{2it} \\T_{it} &= \beta_{31}K_{it} + \beta_{32}G_{it} + \beta_{34}KH_{it} + u_{3it}\end{aligned}$$

şeklinde kurulmaktadır. Model yapısı kapsamında, göç, kayıtdışı ve turizm değişkenleri içsel değişkenler olurken istihdam, vergi gelirleri ve kamu harcaması değişkenleri dışsal değişken olmaktadır.

Tablo 2.'de üç aşamalı en küçük kareler yöntemi kullanılarak elde edilen sonuçlar gösterilmektedir.

Tablo 5. Sabit Etki EKK Model Tahmini

| Göç | |
|-------------------------------------|-----------|
| Kayıtdışı | 0.8129** |
| Turizm | 1.2682** |
| İstihdam | -1.384*** |
| $R^2 = 76.92$ Wald testi : 403.02** | |
| Kayıtdışı | |
| Turizm | 0.2308** |
| Göç | 0.1384*** |
| Vergigeliri | 0.9090** |
| $R^2 = 72.52$ Wald testi : 360.76** | |
| Turizm | |
| Kayıtdışı | -0.1364** |
| Göç | -0.0020** |
| Kamuharcaması | 0.0326** |
| $R^2 = 68.92$ Wald testi : 298.05** | |

(*,**,*** sırasıyla %1, %5 ve %10 önem düzeylerini ifade etmektedir.)

Tablo 2.'de kayıtdışı ve turizmin göç üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif etkisi olduğunu istihdam değişkeninin ise göç üzerindeki etkisinin istatistiksel olarak anlamlı ve negatif olduğu gözlemlenmektedir. Turizm, göç ve vergi geliri değişkenleri kayıtdışılık üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif etkisi bulunmaktadır. Kayıtdışı ve göç turizm üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve negatif olurken kamu harcaması değişkeninin göç üzerindeki etkisi istatistiksel olarak anlamlı ve pozitiftir. Modelin genel anlamlılığı için Wald test sonuçlarına göre modelin anlamlı olduğu belirlenmektedir. Modele ilişkin R^2 değerleri sırasıyla %76.92, %72.52 ve %68.92 olarak bulunmaktadır.

4.SONUÇ

Sosyoekonomik kavramlar olan turizm ve göç birbirleriyle etkileşim içinde olmaktadır. Göç hareketleri turizm talebinin yoğun olduğu yerleşim yerlerine doğru gerçekleşmekteyken, turistik faaliyetlerin sona ermesiyle tersine göç hareketleri ortaya çıkmaktadır. Ülkelerde turizmin gelişmesi, beraberinde sosyo-ekonomik kalkınmayı getireceğinden göçe neden olan gerekçeler de kendiliğinden ortadan kalkmakta ve turizm, göçü durdurabilen önemli bir potansiyele sahip olmaktadır. Bununla birlikte, göç eden

vatandaşların kendi ülkeleri için turizm pazarının büyük bir payını oluşturduğu ve göç ettikleri ev sahibi ülkelere turist akışı sağladıkları (akrabaları/ arkadaşları vb.) sonucuna varılabilmektedir.

Kayıtdışı istihdam ve kayıtdışı ekonomi son yıllarda çözümler üretilmesi gereken önemli bir sorun olarak ortaya çıkmaktadır. Göçmenlerin çalışma hakları hususunda yeterli bir düzenlemeye sahip olunmaması kayıtdışı ekonomi ve istihdamın, yaşanmasına neden olmaktadır. Özellikle mevsimsel işçi barındıran turizm sektöründe istihdama yol açan bu durum kayıtdışılıkta artışa neden olmaktadır. Turizmin yoğun olduğu bölgelerde kayıtdışı sektöre giriş ve çıkış daha kolay olduğundan, kayıtdışı istihdamın olduğu bölgelere doğru işçi göçü gerçekleştirilmektedir. Bu durum göç ve kayıtdışı ile arasında pozitif ve dolaylı bir ilişki ortaya koymaktadır. Göç edenlerin önemli kısmının iş bulmak amacıyla bulunduğu yeri terk etmesi varsayımı altında istihdamdaki artış göç üzerinde negatif bir etkiye sahip olmaktadır. İstihdam, göç üzerinden dolaylı bir şekilde turizm sektöründe pozitif bir etkiye sahip olmaktadır. Turizm sektörünün yoğun olduğu bölgelerde göçmen nüfusun arttığı gözlemlenmekte ve buna paralel olarak konaklama ve kültür-eğlence tesislerinde istihdam edilen kişi sayısında artış yaşanmaktadır.

Devletin veya devletin yetkilendirdiği diğer kamu tüzel kişilerinin belirli bir dönemde tahsil ettikleri toplam vergi tutarı olan vergi gelirleri, kayıtlı ekonomiden toplanmakta ve kayıtlı ekonomi üzerine yüksek vergi oranlarının uygulanması durumunda kayıtdışı ekonomide artış gözlemlenmekte ve kayıtlı ekonominin azalmasıyla vergi gelirlerinde düşüşe neden olan bir sarmala dönmektedir. Devlete ödemekle yükümlü olduğu prim ve vergileri ödemekten kaçınan işverenler, kayıtdışı işçi çalıştırarak bu yükümlülüklerden kurtulduklarını düşünmektedirler. Bu durum işveren için olumlu gözükse de çalışan için olumsuz bir sonuç doğurmaktadır. Turizmde çalışan göçmen kayıtdışı işçilerin tespit edilmesi durumunda uygulanacak cezai işlemler sektörü tehdit eden olumsuz bir faktör olarak ortaya çıkmakta ve hem göç hem de kayıtdışı, turizm gelirlerini negatif yönde etkilemektedir.

Turistlerin, ülkeye girişleri ve o yapmış oldukları tüketim harcamaları üzerinden çeşitli vergiler alınarak gelir elde etmektedirler. Ülkelerin turizmi teşvik etmek amacıyla yaptıkları kamu harcamalarındaki artış turizmi arttırmakta ve artan turist sayısı doğrultusunda gerçekleşen yeni ihtiyaçlar doğurmaktadır. Bu yapılanmalar, hizmetin kalitesini arttırmak için söz konusu bölgeye olan kamu harcamalarında artışa neden olmaktadır. Bölgedeki yapılanmalar, ekonominin canlanmasını etkilemekte ve göçmen işçilerin gelmesine ortam hazırlamaktadır.

KAYNAKÇA

- Adam & Ginsburgh, M. &. (1985). The Effects of Irregular Markets on Macroeconomic Policy : Some Estimates for Belgium. *European Economic Review*, 29(1): 15-33.
- Barutçugil, İ. S. (1989). *Turizm İşletmeciliği 3. Baskı*. İstanbul: Beta Basım Yayım Dağıtım.
- Camarota, S. A. (1997). The Effect of Immigration on Low-skilled Native Workers: Evidence from the June 1991 Current Population Survey. *Social Science Quarterly*, 78(2), p. 417–431.
- Chen, M. (2012). *The Informal Economy: Definitions, Theories and Policies*. Women in Informal Employment Globalizing and Organizing (WIEGO) Working Paper No:1 .
- Dustman& Fabbri& Preston& Wadsworth. (2003). *The Local Labour Market Effect of Immigration in the UK*. Home Office Online Report 06/03.
- Feige, E. (1990). *Defining and Estimating Underground and Informal Economies: The New Institutional Economics Approach*. 7.
- Finnie, R. (2000). *The who moves? A Panel Logit Model Analysis of Inter-provincial Migration in Canada*. Analytical Studies Branch – Research Paper Series, 142: 1–24.
- Fleming& Roman& Farrell. (2000). *The Shadow Economy*, *Jornual of International Affraids*, 53(2). s. p. 387-409.
- Gujarati, D.N. (1995). *Basic Econometrics (3rd Ed.)*. McGraw-Hill International Editions. New York
- Henderson & Smith. (2015). *The Informal Tourism Economy at Beach Resorts: A Comparison of Cha-Am and Laguna Phuket in Thailand*. *Tourism Recreation Research*, 34:1 , p.15.
- Kızılot&Çomaklı. (2004). *Vergi Kayıp ve Kaçaklarının Mevzuat Açısından Değerlendirilmesi*. 19. Maliye Sempozyumu. Ankara: Yaklaşım Yayınları.
- Öğünç & Yılmaz. (2000). *Estimating Underground Economy in Turkey*. The Central Bank of The Republic of Turkey , s. Discussion Paper.
- Pischke & Velling. (1997). *Employment Effects of Immigration to Germany: An Analysis Based on Local Labor Markets*. *The Review of Economics and Statistics*, 79(4) , p. 594–604.
- Portes & Castells & Bento& Loayza. (1989,1997). *The informal economy: Studies in advanced and less developed countries, The economics of the informal sector : a simple model and some empirical evidence from Latin America*. *Baltimore: Johns Hopkins University Press* , s. p.12; Loayza p.1.
- Schneider& Klinglmair. (2004). *Shadow Economies Around The World: What Do We Know?* Center for Research in Economics, Management and the Arts, Working Paper .

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Schneider, F. (2000). The Growth of the Shadow Economy in the OECD : Some Preliminary Explanation. Journal of International Affairs, 53(2) , p. 413-431.

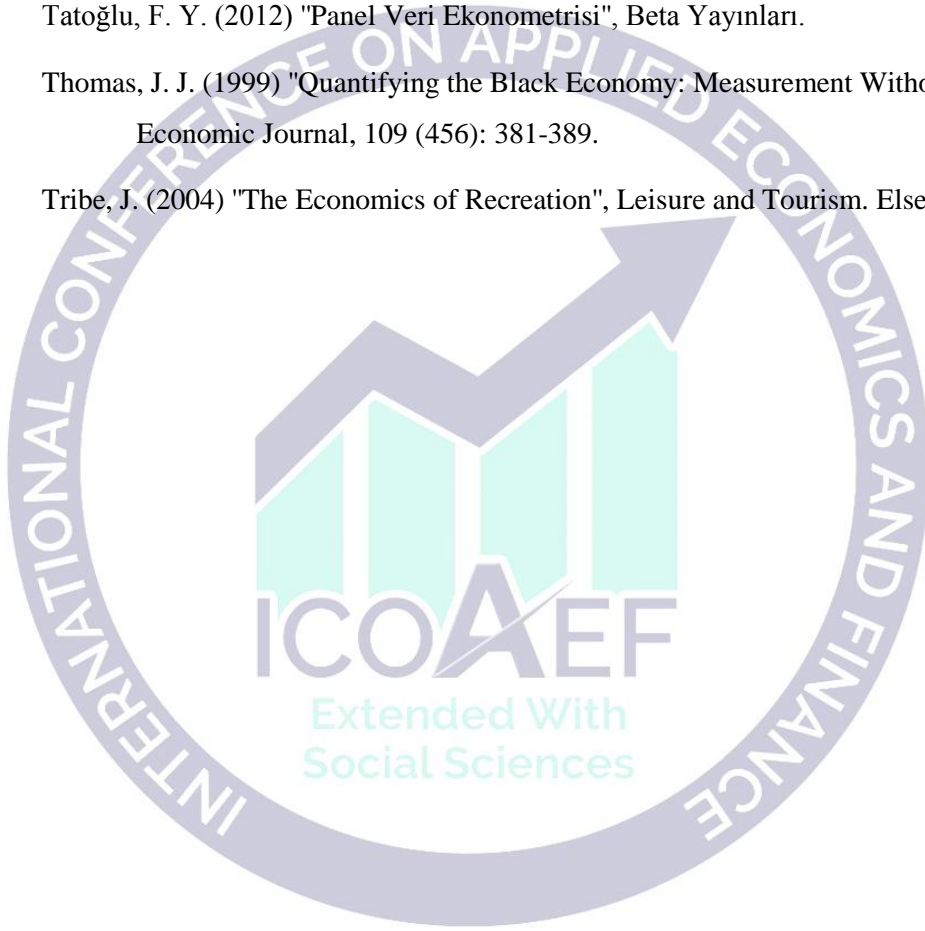
Smith, P. (1994). Assessing the Size of the Underground Economy: The Canadian Statistical Perspectives. Canadian Economic Observer, Catalogue No.: 11-010, 3.16-33 .

Şit, M. (2016). Türkiye’de Turizm Sektörünün İstihdama Katkısı . Akademik Yaklaşımlar Dergisi Journal Of Academic Approaches Cilt:7 Sayı:1 , p. 104.

Tatoğlu, F. Y. (2012) "Panel Veri Ekonometrisi", Beta Yayınları.

Thomas, J. J. (1999) "Quantifying the Black Economy: Measurement Without Theory Yet Again?" The Economic Journal, 109 (456): 381-389.

Tribe, J. (2004) "The Economics of Recreation", Leisure and Tourism. Elsevier, Oxford .



GÖÇ VE BEŞERİ SERMAYE: DOĞU AVRUPA ÜLKELERİ

M. Kenan TERZİOĞLU*

Seçil SERT**

Murat AYGÜN***

ÖZET

Göç, bir ülke ya da toplumdaki ekonomik, politik, sosyo-kültürel oluşumla bağlantılı dinamik bir süreçtir. İktisadi kalkınma sürecinde beşeri sermayenin rolü ve etkisi, ülkelerin ve bölgelerin gelişmişlik seviyelerine bağlı olarak farklılık gösterdiğinden göç üzerinde önemlidir. Uluslararası alanda rekabet edebilme kabiliyetini etkileyen önemli unsurlardan bir olan beşeri sermaye birikimi, ülkelerin makroekonomik performansının ve ülkeler arasındaki rekabetin açıklanmasında önemli olmaktadır. Toplamların sahip olduğu bilgi, beceri, yetenek, sağlık durumu, toplumsal ilişkilerdeki yeri ve eğitim düzeyi gibi kavramları ifade eden ve ekonomik büyümenin temel kaynağını oluşturan beşeri sermaye ile göç arasındaki ilişkinin Doğu Avrupa ülkeleri için dinamik panel veri analiz ortaya çıkarılması amaçlanmaktadır.

Anahtar Kelimeler: *Göç, Beşeri Sermaye, Harcamalar, Kalkınma, Dinamik Panel Veri Analizi*

MIGRATION and HUMAN CAPITAL: EASTERN EUROPEAN COUNTRIES

*Extended With
Social Sciences*

ABSTRACT

Migration is a dynamic process associated with the economic, political, socio-cultural formation in a country or community. Since the role and impact of human capital in the process of economic development varies according to the level of development of countries and regions, it is important on migration. Human capital accumulation, which is one of the important factors affecting the ability to compete in the international arena, is important in explaining the macroeconomic performance of countries and the competition between countries. It is aimed to reveal the relationship between human capital, which expresses concepts such as knowledge, skills, talent, health status, place in social

* Doç.Dr., Trakya Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, Ekonometri Bölümü, Ekonometri Anabilim Dalı, kenanterzioglu@trakya.edu.tr

** Yüksek Lisans Öğrencisi, Trakya Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, Ekonometri Anabilim Dalı,secilsert2291@gmail.com

*** Yüksek Lisans Öğrencisi, Trakya Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, Ekonometri Anabilim Dalı,murataygun@gmail.com

relations and level of education, and constitutes the main source of economic growth, and migration by using dynamic panel data analysis method for Eastern European countries.

Key Words: *Migration, human capital, expenditures, development, dynamic panel data analysis*

1.GİRİŞ

İletişim ve ulaşım teknolojilerindeki gelişmeler kolay ve hızlı yer değişimini sağlamaktadır. Birden çok faktörle ortaya çıkabilen ve süreç içinde niteliği değişebilen bir hareketlilik olan göç, ekonomik ve sosyal yaşamı etkileyen temel değişim araçlarından birisidir. Doğulan yerle ilgili etmenler, gidilen yerle ilgili etmenler, müdahale engeli ve kişisel etmenler olmak üzere göç kararını etkileyen dört önemli etmen bulunmaktadır (Parkins, 2015). Küresel ölçekte ortaya çıkan yer değiştirme hareketliliği göç çağı ve göç türbülansı olarak tanımlanmaktadır (Papastergoadis, 1999; Castles, 2008; Miller, 2008). Göç mekanizması incelendiğinde göçün yönünün, yoğunluğunun ve akımının Kuzey Amerika' ya ve Batı Avrupa' ya doğru olduğu gözlemlenmektedir.

Toplumun reel milli gelirinin devamlı ve kümülatif olarak artışı sağlayan, sosyal, kültürel ve politik değişkenlerin bileşimi olarak tanımlanan kalkınmanın amacı, toplumsal refahı arttırmaktır. Bireylere yapılan yatırımları, diğer bir ifadeyle eşit imkan/fırsat sunulumu ve yaşam standartının (eğitim, sağlık, sosyal güvenlik, teknolojik yatırımlar, gelir vb.) iyileşmesini beraberinde getiren kalkınma, dengeli ve sürdürülebilir bir büyüme süreci sağlarken göç üzerinde de azaltıcı etkiye sebep olmaktadır. Kalkınmada, sağlık harcamalarının da etkisi olduğundan gerekli koşullarının sağlanması gerekmektedir (Miller, 2008). Kalkınma ve ekonomik büyüme ile birlikte yükselen kişi başına gelir, sağlık hizmetlerine ulaşım imkânının artmasına, sağlık hizmetlerinin kalitesinin yükselmesine ve sağlık harcamalarının artmasına neden olmaktadır. Sağlık sektöründeki iyileşmenin ekonomik büyüme üzerindeki etkisi beşerî sermaye teorisi çerçevesinde incelenmektedir. Beşerî sermaye, insanlara bilgi ve beceri kazandırmak için yapılan eğitim ve sağlık gibi harcamaları ifade etmektedir. Elde edilmesi beklenen gelirin göç maliyetleri göz önüne alındığında ve göç edilen ülkedeki gelirden daha yüksek olması durumunda göç hareketliliği gerçekleşmektedir. Fayda/maliyet yaklaşımı bireylerin göç etme kararının, göçün fayda ve maliyetlerine bağlı olduğunu savunmaktadır. Beşerî sermaye de fiziksel sermaye gibi üretim faktörlerinden biri olarak sayılmaktadır (Nekelo, 1991; Lucas, 1998). Sağlık, eğitim ve etkinlik düzeyinin yükseltilmesiyle uzun dönemde fayda sağlayan beşerî sermaye sonucunda verimlilik artışı meydana gelmekte ve ülkelerin ekonomileri üzerinde olumlu etkiler ortaya çıkabilmektedir. Beşerî sermaye, göç sebebinin oluşmasından, göç kararının alınmasından, göç edilecek yerin seçimi ve göç edilen yerdeki yaşama koşullarının belirlenmesine kadar geniş bir alanda göç hareketliliği üzerinde etkili olmaktadır. Schultz(1961), göç ve beşerî sermaye kavramını beraber incelemekte ve büyüme oranının önemli bir bölümünü eğitime olan yatırımlar tarafından açıklandığını

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

vurgulamaktadır. Denison(1962), eğitimin işgücünün beceri ve üretkenlik kapasitesini geliştirdiği ve milli gelirin artmasına katkıda bulunduğunu ifade etmektedir. Beşeri sermayeye yapılan yatırımların ekonomik ve sosyal düzeyde olumlu getirileri olmaktadır. Toplumda daha etkin olabilme ve içinde bulunulan sosyal sınıfta yükselme, eğitimin kişisel getirileri olmaktadır (Taban ve Kar, 2004). Beşeri sermayeye göre sahip olunan bilgi ve beceri geliştirildiğinde iktisadi faaliyetlerde üretkenlik artmaktadır. Kişinin iyi eğitim alabilmesi ve iktisadi faaliyetlerde bulunabilmesi için sağlık düzeyi de önemli olduğundan beşeri sermaye stokunda sağlık ve eğitim beraber değerlendirilmektedir (Karagül, 2002). Beşeri sermaye hem eğitim ve sağlık harcamaları aracılığı ile programlı olarak hem de üretim aşamasında kendiliğinden oluşturulmaktadır (Atamtürk, 2007).

Bireyin beceri ve bilgi edinmesi için ön plana çıkan öğrenme ve eğitim süreçleri etkinlik ve sosyal uyumu teşvik etmede bir araç olarak görülmektedir. Yüksek eğitim düzeyine sahip toplumlar, teknolojik yenilikler geliştirerek uzun vadede ekonomik büyüme ve kalkınmayı teşvik edebilmektedir. Eğitim seviyesi, fiziksel sermayenin ve işgücünün marjinal verimliliğini arttırmakta ve ülkenin milli gelirini yükseltmektedir. Bununla birlikte, eğitilmiş kişiler sağlık sorunlarından kaynaklanabilen üretim kayıplarını da azaltabilmektedir. Eğitilmiş toplumların kısa, orta ve uzun vadede yaşam standartları yükselmektedir. Eğitim standartlarının yükseltilmesi için emek, zaman ve sermaye harcanması ve bu maliyetlere katlanılması zorunludur. Ülkelerin gelişmişliği eğitim kalitesinin ne kadar yüksek olup olmadığı ile ilgili olmakta ve eğitimle ilgili çok sayıda program organize eden ülkelere kısa, orta veya uzun vadede eğitim hareketliliğinden dolayı göç hareketliliği olmaktadır. Eğitim ve sağlık alanlarında gerçekleştirilen yatırımlar bireylerin beşeri sermaye düzeyini doğrudan etkilediğinden kısa veya uzun dönemde ekonomik büyümeye katkı sağlamaktadır. Bu nedenle ekonomik gelişmişlik seviyesi yüksek olan ülkelerde eğitim ve sağlık düzeylerinin yüksek olduğu görülmektedir (Çetin ve Ecevit, 2010).

İnsanların bir yerden başka bir yere gitmesi, asıl olarak, sermayesi düşük, işgücü arzı yüksek olan göç veren ülkelerle sermayesi yüksek ancak sanayilerini besleyecek işgücüne ihtiyaç duyan göç alan ülkeler arasındaki yapısal farktan kaynaklanmaktadır(Hagen-zanker,2011). Ücretlerde eşitlik sağlanana kadar göç artışı sürmekte; dolayısıyla işçiler düşük ücretli ekonomilerden yüksek ücretli olanlara göç etmektedir(King,2012). Göç hareketliliği göç maliyetleri göz önüne alındığında, elde edilmesi beklenen gelirin göç edilen ülkelereki gelirden daha yüksek olması durumunda gerçekleştiğinden ücret farklılıkları göçün temel belirleyicileri arasında yer almaktadır. Çarpan etkisi ile artan sağlık harcamaları toplam harcamalarda ve toplam talepte artışa neden olmaktadır. Sağlık harcamalarındaki artış, sağlık sektörü kapsamında, ekonomide istihdam alanı oluşturarak toplam gelir harcamalarını arttırmaktadır. Ek olarak, yükselen refah ile birlikte sağlık hizmetlerinin üretim ve tüketimi yükselmektedir. Ulusal sağlık hizmetleri sağlık alanına büyük ölçüde kamusal nitelik kazandırmaktadır (Yılmaz ve Yentürk, 2015). Bazı ülkelerde sağlık hizmetlerinin sunumu ve finansmanı tamamen kamu tarafından sağlanmaktayken, bazılarında hizmet hem kamu hem de özel sektör tarafından sağlanmaktadır. Nüfus

artışı yapılan harcamaların miktarının ve niteliğinin değişmesiyle kamu harcamalarını artırabilmektedir. Sağlık harcamalarının fiziki sermayeden daha fazla önem kazandığı günümüzde beşeri sermayeye yapılacak her türlü yatırım kamu harcamalarının artmasına neden olmaktadır. Toplam vergi geliri, eğitim ve sağlık harcamalarını arttırmaktadır.

Mayer(2001), eğitimden ziyade sağlıklı nüfusun uzun vadede insan sermayesi için daha önemli olduğunu göstermektedir. Gyimah vd.(2004), sağlık şoklarının kişi başına düşen milli gelirden artma yarattığını ortaya koymaktadır. Duman (2008), eğitim harcamalarının gelir eşitsizliğini azaltıcı bir etkisinin olduğunu vurgulamaktadır. Kurekova(2011), göçün piyasalarda işgücünden elde edilen kazançlardaki farkların bir nedeni ve fonksiyonu olduğunu ifade etmektedir. Yaşlılığın göç etme ihtimalini azalttığını ve eğitimin ise göç etme ihtimalini arttırdığını göstermektedir. Akdur (2016), sağlık harcamalarına ayrılan miktarının azalmasının göçü arttırdığını vurgulamaktadır. Darbeo (2017), uluslararası göç artışının Doğu Avrupa ülkelerinde ekonomik kalkınmasını olumsuz yönde etkilediğini ve göç kararı alınırken kişisel gelişme etmenlerinin önemli olduğunu vurgulamaktadır.

Ekonomik kalkınmanın sağlanmasında temel rolü olan sağlık harcamaları ülkelerin gelişmişlik düzeylerine göre farklılık göstermekte ve gelişmiş ülkelerdeki sağlık harcamalarına ayrılan pay gelişmekte olan ülkelere göre daha yüksek olmaktadır. Ekonomik gelişmişlik seviyesi yüksek olan toplumlarda sağlık için ayrılan kaynaklar arttığı gibi, bireylerin sağlık bilinci de yükselmektedir. Doğu Avrupa ülkelerinde kalkınmanın tam anlamıyla sağlanmamasının kaynağında geleneksel sektör anlayışı ve diğer Avrupa ülkelerine akış yatmaktadır (Vogler ve Rotte, 2000). Doğu Avrupa ülkelerinde kalkınmanın, yönetim ve organizasyon açısından incelenmesi gerekmektedir. İş ile insan ilişkisinin doğru olarak düzenlenmesi kapsamında, sahip olunan iş ile ilgili bilgi düzeylerini artırıcı yönde eğitim programlarına dahil olunmasıyla ortaya çıkan verimlilik artışı, kalkınma üzerinde engel teşkil eden göç hareketliliğinin olumsuz etkisini ortadan kaldırılabilmektedir. Göç hareketliliği göç maliyetleri göz önüne alındığında, elde edilmesi beklenen gelirin göç edilen ülkelerdeki gelirden daha yüksek olması durumunda gerçekleştiğinden ücret farklılıkları göçün temel belirleyicileri arasında yer almaktadır. Bireylerin en temel sağlık hizmetlerine ulaşımının sağlanması açısından sağlık harcamaları önemli olmaktadır. Doğu Avrupa ülkelerinin sosyal devlet anlayışı çerçevesinde sağlığın korunması ve geliştirilmesi için gerekli sağlık hizmetlerinin sunumu ve finansmanının sağlanması amacıyla kendi yönetim biçimlerine göre sağlık sistemleri oluşturulmaktadır.

2. PANEL VERİ ANALİZİ

Statik modellerde, parametrelerin tahmini için belirlenen tahmin edicinin özellikleri büyük ölçüde bireysel etkilere bağlıdır. Belirli bir dönemde belirli bir finansal davranış büyük ölçüde önceki deneyimlere ve eski davranış tarzlarına bağlı olduğundan, finansal ilişkilerin analizinde, değişkenlerin

gecikmeli değerlerini açıklayıcı faktörler olarak ele alınması daha etkin sonuçlar elde edilmesini sağlamaktadır. y_{it} i. birey için t süresi boyunca gözlemlenen bağımlı değişken, x_{it} açıklayıcı değişkenleri, z_{it} zamandan bağımsız ek açıklayıcı değişkenleri, η_i bireysel etkileri, ε_{it} gözlemlenemeyen hata terimi olmak üzere, $i = 1, \dots, N$ birim boyutunu ve $t = 1, \dots, T$ zaman boyutu için, dinamik panel veri modeli : $y_{it} = \gamma y_{i,t-1} + x'_{it}\beta + z'_i\rho_1 + \eta_i + \varepsilon_{it}$

şeklinde ifade edilmektedir. Dinamik panel veri modelleri, dağıtılmış panel veri ve otoregresif panel veri modelleri olmak üzere iki grup olarak incelenmektedir. Bu model yapısında karşılaşılan problemlerden bir tanesi gecikmeli bağımlı değişkenin modelde bağımsız değişken olarak yer alması ve hata terimi ile korelasyonlu olmasından dolayı katı dışsallık varsayımının bozulmasıdır. Gecikmeli bağımlı değişken ile hata terimi arasındaki korelasyon sorunu uygun bir araç değişken seçimi ile kontrol edilebilmektedir. Araç değişkenin hata terimi ile korelasyonsuz olması ve yerine kullanılan değişken ile yüksek korelasyonlu olması gerekmektedir. Hata terimi içerisinde yer alan birim etkinin bağımsız değişkenlerden birisi ile korelasyonlu olması tesadüfi etkiler modelinin varsayımını bozmakta ve tahminler tutarsız olmaktadır. Bu nedenle dinamik panel veri modellerinin tahminlerinde genellikle birim etkileri göz önüne alan ve birim etkiler ile bağımsız değişkenlerinin korelasyonlu olmasına izin veren sabit etkiler ve birinci fark tahmincileri kullanılmaktadır. Sabit etkiler varsayımıyla yapılan grup içi dönüşüm birim etkiyi yok etmektedir. Birinci fark dönüşümü yapıldıktan sonra birim etki modelden düşmektedir. Gecikmeli bağımlı değişken içsel olduğundan sapmalı tahminler elde edilmektedir. Bu nedenle birinci fark dönüşümü yapıldıktan sonra gecikmeli bağımlı değişken ve hata terimi arasındaki korelasyon araç değişken kullanılarak kontrol edilmektedir. Anderson ve Hsiao (1981), dinamik modellerde, birinci farkları kullanarak birim etkinin göz ardı edilebileceğini göstermektedir. Bireysel etkileri ortadan kaldırmak için, bir önceki zaman dilimine göre fark uygulanmaktadır.

$$y_{it} - y_{i,t-1} = \gamma(y_{i,t-1} - y_{i,t-2}) + (x'_{it} - x'_{i,t-1})\beta + \varepsilon_{it} - \varepsilon_{i,t-1} \quad (1)$$

$y_{i,t-2}$ ve $y_{i,t-1} - y_{i,t-2}$ arasında korelasyon olmasına rağmen, $\varepsilon_{it} - \varepsilon_{i,t-1}$ ile korelasyon bulunmamaktadır. γ ve β' yi tahmin etmek için, $y_{i,t-1} - y_{i,t-2}$ 'nin araç değişkeni olarak $y_{i,t-2}$ kullanılmaktadır. Diğer açıklayıcı değişkenler $x'_{it} - x'_{i,t-1}$ ve $\varepsilon_{it} - \varepsilon_{i,t-1}$, ilişkili olmadığı için, $x'_{it} - x'_{i,t-1}$ araç değişken olarak kullanılmaktadır.

$$E(y_{i,t-2}(\varepsilon_{it} - \varepsilon_{i,t-1})) = 0$$

şeklinde olmaktadır. Araç değişkenler açıklayıcı değişkenlerle ilişkili olduğunda, hata terimi korelasyonlu olmamalıdır. Denklem (1) matris formunda $\Delta y = \gamma \Delta y_{-1} + \Delta X \beta + \Delta \varepsilon$ olarak yazılabilmekte ve araç değişken matrisi $[y^* \Delta X]$ olarak tanımlanmaktadır. Bu durumda, araç tahmin edicileri

$$\begin{bmatrix} \hat{\gamma}_{IV} \\ \hat{\beta}_{IV} \end{bmatrix} = [Z'[\Delta y_{-1} \Delta X]]^{-1} Z' \Delta y$$

şeklinde gösterilmekte ve γ , β parametreleri için tutarlıdır. Araç değişkenler yöntemi, dinamik panel veri modellerinin tutarlı bir tahminini sağlarken, etkin olmayan tahmin ediciler üretmektedir (Arellano and Bond, 1991). Birinci farklar modelinin hata terimleri sabit varyanslı ve otokorelasyonsuz olduğundan Anderson ve Hsiao tahmincisi iyi bir seçim olmaktadır. Bununla birlikte, birinci fark hata terimleri genellikle negatif otokorelasyonlu olduğunda, Arellano ve Bond'un (1991) genelleştirilmiş momentler metodu (GMM) tahmincisinin kullanılması daha uygun olmaktadır.

Arellano ve Bond (1991), dinamik panel veri modellerinde tüm geçerli, gecikmeli değişkenlerin araç değişkenler olarak kullanılan GMM' yi önermektedir. Bu yöntemde birinci fark modeli araç değişken matrisi kullanılarak dönüşüm yapılmakta ve sonrasında genelleştirilmiş EKK ile tahmin işlemi gerçekleştirilmektedir (Soto, 2009). Arellano ve Bond (1991), $y_{i,t-1} - y_{i,t-2}$ için $y_{i,t-2}$ nin dışında başka araç değişkenler olabileceğini göstermektedir. Eğer $y_{i,t-2-j} = 0, 1, \dots$, değişkenini, $E[y_{i,t-2-j}(y_{i,t-1} - y_{i,t-2})] \neq 0$ ve $E[y_{i,t-2-j}(\varepsilon_{i,t-1} - \varepsilon_{i,t-2})] = 0$ koşullarını karşılırsa, $y_{i,t-2}, y_{i,t-3}, \dots, y_{i,0}$ değişkenleri, $y_{i,t-1} - y_{i,t-2}$ için geçerli araç değişkenler olabilmektedir. Arellano-Bond GMM tahmincisi

$$\begin{bmatrix} \hat{\gamma} \\ \hat{\beta} \end{bmatrix} = ([\Delta y_{-1} \Delta X]' W') (W (I_N \otimes G) W')^{-1} (W [\Delta y_{-1} \Delta X])^{-1} ([\Delta y_{-1} \Delta X]' W') (W (I_N \otimes G) W')^{-1} (W \Delta y)$$

şeklinde elde edilmektedir. Otopregresif parametreler çok fazla ya da birim etkinin varyansı artık hatanın varyansına oranı yüksekse bu yöntem zayıf kalmaktadır. Arellano ve Bover (1995) dinamik panel veri modelleri için ortogonal sapmalar yöntemini kullanarak etkin araç değişken tahmincisini önermektedir. Bu yöntemde birinci farklar yönteminde olduğu gibi cari dönemden bir önceki dönemin farkının alınması yerine bir değişkenin tüm mümkün gelecek değerlerinin ortalamasının farkı alınmaktadır. $\alpha_{it} = \eta_i + \varepsilon_{it}$ şeklinde tanımlandığında, η_i ile korelasyonlu olmayan x_{1it} zamana bağlı eksojen değişkenler, η_i ile korelasyonlu olan x_{2it} zamana bağlı eksojen değişkenler, η_i ile korelasyonlu olmayan z_{1i} zamandan bağımsız eksojen değişken ve η_i ile korelasyonlu z_{2i} zaman bağımsız eksojen değişken olmak üzere, $i = 1, \dots, N$ ve $t = 1, \dots, T$ iken Hausman ve Taylor (1981)

$$y_{it} = \gamma y_{i,t-1} + x'_{1it} \beta_1 + x'_{2it} \beta_2 + z'_{1i} \rho_1 + z'_{2i} \rho_2 + \eta_i + \varepsilon_{it} \quad (2)$$

olduğunu göstermektedir. $w_i = [x'_{i1}, x'_{i2}, \dots, x'_{iT}, z'_{i1}, z'_{i2}, \dots, z'_{iT}, y_{i0}, \dots, y_{i,t-2}]'$ ve $\varepsilon_{iT} - \varepsilon_{i,T-1}$ veya $m_i = [x'_{i11}, x'_{i21}, \dots, x'_{iT}, z'_{i1}]'$ ve $\bar{\alpha}_i$ arasında korelasyon yoktur (Breusch, 1989). $m_i = [x'_{i11}, x'_{i21}, \dots, x'_{iT}, \tilde{x}_{2i1}, \tilde{x}_{2i2}, \dots, \tilde{x}_{2iT}, z'_{i1}]'$ iken $\tilde{x}_{2it} = x_{2it} - \bar{x}_{2i}$ ve $\bar{\alpha}_i$ arasında bir korelasyon olmadığını ifade etmektedir.

$$m_i = \sum_{i=1}^N M_i H \begin{bmatrix} y_{i,1} - \gamma y_{i,0} + x'_{1i1}\beta_1 + x'_{2i1}\beta_2 + z'_{1i}\rho_1 + z'_{2i}\rho_2 \\ y_{i,2} - \gamma y_{i,1} + x'_{1i2}\beta_1 + x'_{2i2}\beta_2 + z'_{1i}\rho_1 + z'_{2i}\rho_2 \\ \vdots \\ y_{i,T} - \gamma y_{i,1} + x'_{1iT}\beta_1 + x'_{2iT}\beta_2 + z'_{1i}\rho_1 + z'_{2i}\rho_2 \end{bmatrix} \quad (3)$$

eşitliğinde, γ ve β parametrelerinin GMM tahmini $\bar{m}'Am'$ ifadesini en küçükleyen γ ve β değerleridir. A matrisi için en iyi aday $\bar{m}'in$ kovaryans matrisi. Kovaryans matrisi bilinmiyorsa, tutarlı bir tahmin ediciyi kullanmak uygun olmaktadır. Eğer $\tilde{\sigma}_\varepsilon^2$ ve $\tilde{\sigma}_\mu^2$, σ_ε^2 ve σ_μ^2 parametrelerinin, tutarlı tahmincisi ise $\hat{\Sigma} = \tilde{\sigma}_\varepsilon^2 I_T + \tilde{\sigma}_\mu^2 I_T I_T'$, Arellano ve Bover GMM tahmincisi,

$$\begin{bmatrix} \hat{\gamma} \\ \hat{\beta} \end{bmatrix} = ([y_{-1}X]'M')(M(I_N \otimes \hat{\Sigma})M')^{-1}(M[y_{-1}X])^{-1} * ([y_{-1}X]'M')(M(I_N \otimes \hat{\Sigma})M')^{-1}(M_y) \quad (4)$$

olarak gösterilmektedir(Tatoğlu,2012).

3. GÖÇ ve BEŞERİ SERMAYE ETKİLEŞİMLERİ

Bulgaristan, Romanya, Litvanya, Letonya, Polonya, Slovenya, Slovak Cumhuriyeti, Estonya, Slovakya olmak üzere seçilmiş olan 9 Doğu Avrupa ülkelerine ait 2005-2016 yıllık veriler kullanılarak beşeri sermayenin göç üzerindeki etkisi dinamik panel veri yöntemleri kullanılarak ortaya çıkarılması amaçlanmaktadır. Çalışmanın kapsamında, göç değişkeni olarak belirli bir alanın aldığı göç ile verdiği göç arasındaki fark, beşeri sermaye olarak ülkelerin sağlık harcamaları ve eğitim harcamaları alınmaktadır. Göç ile ilgili veriler Central Intelligence Agency (CIA) tarafından elde edilirken, diğer değişkenlere ait veriler OECD, Eurostat ve Dünya Bankası'ndan elde edilmektedir. Etkileşimin daha iyi anlaşılması için göç ve beşeri sermaye verileriyle ilişkili olan, büyüme ve gelir dağılımı değişkeni de model yapısına dahil edilmektedir. İlgili değişkenlerin logaritmik birinci sıra farkları alınarak 100 ile çarpılması sonucunda yüzde değişimler elde edilmektedir.

Ekonometrik analizler yapılmadan önce serilerin zaman içerisinde sabit olup olmadığı incelenmeli ve sonuçların sapmalı ve yanıltıcı olmaması için durağanlığın test edilmesi gerekmektedir. Panel birim kök testleri birinci ve ikinci kuşak testler olmak üzere ikiye ayrılmaktadır. Birinci kuşak birim kök testleri, paneli oluşturan yatay kesit birimlerinin bağımsız olduğu ve paneli oluşturan birimlerden birine gelen şoktan tüm yatay kesit birimlerinin aynı düzeyde etkilendikleri varsayımına dayanmaktadır. Paneli oluşturan yatay kesit birimlerinden birine gelen bir şoktan birimlerin farklı düzeyde etkilenmesi daha gerçekçi bir yaklaşım olduğundan yatay kesit birimleri arasındaki yatay kesit bağımlılığını göz önünde bulunduran ikinci kuşak birim kök testler kullanılmaktadır. Bu çalışmada birinci kuşak testlerinden Levin, Lin ve Chu, Breitung, Im, Pesaran ve Shin, Hadri LM, Harris- Tzavalis ve Fisher PP ve Fisher ADF testleri, ikinci kuşak testlerinden ise Pesaran's CADF testi kullanılmaktadır.

Tablo 1. Birim Kök Testi Sonuçları

| | G | B | SH | EH | GD |
|------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | I(0) | I(0) | I(0) | I(0) | I(0) |
| Levin, Lin ve Chu | -0.0055** | -7.33436** | -9.0948** | -1.88661** | -7.90372** |
| Harris ve Tzavalis | -1.12211** | -0.18777** | -10.0106** | -1.15676** | -4.42838** |
| Breitung | -1.05897** | 2.1747** | -7.5273** | -3.51461** | -1.68113** |
| Hadri | 2.59501** | 6.99534** | -1.22551** | 2.77409** | 9.3082** |
| Im,Pesaran ve Shin | -0.0055** | -3.32706** | -5.46722** | -7.46581** | -3.72526** |
| Fisher PP | | | | | |
| Inverse χ^2 | 3.75485** | 1.19559** | 7.66689** | 8.37584** | 8.97138** |
| Inverse normal | -4.24974** | 1.47961** | -5.39935** | -9.56956** | -2.66024** |
| Inverse logit | -9.51148** | 1.3156** | -5.50308** | -3.38965** | -4.90347** |
| Modified inv. χ^2 | -4.41903** | -0.74943** | 6.55479** | 2.56498** | 8.26111** |
| Fisher ADF | | | | | |
| Inverse χ^2 | 1.11452** | 6.3778** | 3.1625** | 5.43301** | 3.55014** |
| Inverse normal | 3.09375** | -2.71425** | -0.65758** | -1.18459** | -0.14586** |
| Inverse logit | 3.35566** | -8.52302** | -0.72776** | -1.5015** | -0.57563** |
| Modified inv. χ^2 | -0.76065** | 7.27287** | 0.43857** | 2.73647** | 1.56013** |

(*,** sırasıyla % 5 ve % 10 önem düzeylerini ifade etmektedir.)

Birinci kuşak ve ikinci kuşak testleri incelendiğinde göç(G), büyüme(B), sağlık harcamaları(SH), eğitim harcamaları(EH) ve gelir dağılımı(GD) değişkenlerinin birim kök içermediği yani durağan olduğu gözlemlenmektedir. Sağlık harcamaları, eğitim harcamaları, büyüme ve gelir dağılımı değişkenleri kullanılarak göç ve beşeri sermaye arasındaki ilişkinin ortaya çıkarılması için dinamik panel veri modeli;

$$G_{it} = \beta_1 G_{it-1} + \beta_2 B_{it} + \beta_3 B_{it-1} + \beta_4 B_{it-2} + \beta_5 SH_{it} + \beta_6 EH_{it} + \beta_7 EH_{it-1} + \beta_8 GD_{it} + \beta_9 GD_{it-1} + e_{it} \quad (5)$$

şeklinde kurulmaktadır. Tablo 2.'de Arellano-Bond iki aşamalı genelleştirilmiş momentler tahmin edicisi kullanılarak elde edilen sonuçlar gösterilmektedir.

Tablo 2. Arello ve Bond Tahmin Sonuçları

| Değişkenler | Katsayı | GMM | |
|---------------------------------|---------|----------------|---------|
| | | Standart Sapma | P > z |
| G(1) | -.051 | .066 | 0.011* |
| B | -.180 | 1.346 | 0.043* |
| B(1) | -.106 | 1.339 | 0.034* |
| B(2) | -.508 | 1.355 | 0.020* |
| SH | .750 | .085 | 0.101** |
| EH | -.589 | 1.037 | 0.022* |
| EH (1) | -.321 | 0.036 | 0.003* |
| GD | -.484 | 1.180 | 0.042* |
| GD(1) | -.112 | 1.044 | 0.064** |
| Wald Testi | | 86.72* | |
| Sargan Testi | | 151.839** | |
| Arello Bond Otokorelasyon Testi | | I.Sıra | -3.188* |
| | | II.Sıra | 0.457 |

(*,** sırasıyla % 5 ve % 10 önem düzeylerini ifade etmektedir.)

Tablo 2'de yüzde 5 anlamlılık düzeyinde göçün bir dönem gecikmeli etkisinin göç üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve negatif olduğu gözlemlenmektedir. Büyümenin bir dönem önceki gecikmeli değerinin göç üzerindeki etkisi istatistiksel olarak anlamlı ve negatif bulunmaktadır. Sağlık harcamaları göç üzerinde anlamsız bir etkiye sahipken eğitim harcamaları ve bir dönem gecikmeli değeri göç üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve negatif etkisi elde edilmektedir. Gelir dağılımının bir önceki dönem gecikmesi göç üzerinde istatistiksel olarak anlamlı bulunurken gelir dağılımının etkisi istatistiksel olarak anlamlı ve negatif olarak hesaplanmaktadır. Model anlamlılığını test etmek için kullanılan Wald testi istatistiğine göre modelin anlamlı olduğu söylenebilmektedir. Sargan testi, tahmin için kullanılan araç değişkenlerin yeterli olup olmadığını tespit etmek için kullanılmakta ve aşırı tanımlayıcı kısıtlamaların geçerli olduğunu göstermektedir. Birinci fark modelinin kalıntılarını test eden birinci ve ikinci mertebeden otokorelasyon test sonuçlarına göre, birinci mertebeden negatif otokorelasyon olduğu ancak ikinci mertebeden otokorelasyon olmadığı gösterilmektedir. Dirençli standart hatalar ile hesaplanan z istatistiğine göre, modelde kullanılan bağımsız değişkenlerin büyük çoğunluğu göçü açıklamada istatistiksel olarak anlamlı bulunmadığından sonuçlarda yer verilmemiştir.

Tablo 3. Arello ve Bover / Blundell ve Bond Sistem Tahmin Sonuçları

| Değişkenler | Katsayı | GMM | |
|---------------------------------|-----------------|----------------------|---------|
| | | Standart Sapma | P > z |
| G(1) | -.008 | 0.061 | 0.008* |
| B | -.208 | 1.022 | 0.010* |
| B(1) | -.119 | 1.126 | 0.003* |
| B(2) | -.603 | 1.233 | 0.000* |
| SH | -.808 | 0.079 | 0.048* |
| EH | -.797 | 1.099 | 0.044* |
| EH (1) | -.317 | 1.193 | 0.051** |
| GD | -.364 | 0.554 | 0.037* |
| GD(1) | -.121 | 0.561 | 0.025* |
| Wald Testi | | 108.79* | |
| Arello-Bond Otokorelasyon Testi | | I.Sıra | -3.20* |
| | | II.Sıra | 0.63 |
| Sargan Testi | | 160.67* | |
| | | Difference-in-Sargan | |
| GMM instruments for levels | Excluding Group | 160.40* | |
| | Difference | 0.27* | |
| iv(Y SH IG B Y K GINI K) | Excluding Group | 160.60* | |
| | Difference | 0.07* | |

(*,** sırasıyla % 5 ve % 10 önem düzeylerini ifade etmektedir.)

Tablo 3.'de yer alan Arello-Bover/Blundell-Bond sistem tahmin sonuçlarına göre göçün bir dönem gecikmeli etkisi, büyüme ve büyümenin hem bir hem iki dönem gecikmeli etkisi, sağlık harcamasının etkisi, eğitim harcaması ve bir dönem gecikmeli etkisi ile gelir dağılımı ve bir dönem gecikmeli etkisi göç üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve ters yönlü etkiye sahip olmaktadır. Wald istatistiğinin istatistiksel olarak anlamlı olduğu ve birinci mertebeden negatif otokorelasyon olduğu ancak ikinci mertebeden otokorelasyon olmadığı gösterilmektedir. Sargan test sonuçlarına göre aşırı tanımlayıcı kısıtlamalar geçerli olmamaktadır. Buna ek olarak, araç değişkenlerin geçerliliğini test etmek için kullanılan Fark-Sargan testlerine göre düzey eşitliğinde kullanılan değişkenler içsel olduğundan araç değişkenlerin kullanılması ve araç değişkenler regresyonunda kullanılan araçların ise geçerli olmadığı sonucuna ulaşılmaktadır.

4.SONUÇ

Ekonomik ve sosyal modernleşmeyle birlikte, ülkelerin kalkınma seviyelerinde önemli yer tutan uygulanan eğitim ve sağlık programı uygulamaları ön plana çıkmaktadır. Ülkelerin kalkınma düzeyinin yüksek olması bireylerin dış ülkelere olan göçünü azaltmaktadır. Göç veren ülkelerin kalkınmasında, sağlık harcamalarının etkilerini de göç veren ülkelerdeki ortamın koşullarının önemli olduğunu göstermektedir. Göç veren ülkeler açısından olumlu etki yaratmaktadır. Harcamalarda ve gelir

dağılımında ki artış ekonomik büyümeye katkı sağlamakta ve göç üzerinde negatif etkiye sahip olmaktadır. Aynı zamanda ekonomik büyümenin de harcamalara ve gelir dağılımına pozitif yönde katkı sağladığı gözlemlenebilmektedir. Ülkelerin sağlık ve eğitim harcamaları, beşeri sermaye üzerinde olumlu etki yaratmaktadır. Sağlık harcamaları ve eğitim harcamaları, ülkelerin gelişmişlik düzeylerinin analizinde kullanılan en önemli göstergelerden birisi olmaktadır. İnsani kalkınma insanların en temel ihtiyaçlarının rahat karşılanmasına, sağlıklı bir ortamda yaşamlarını sürdürmelerine ve eğitim düzeyini artırarak bireylerin kendilerini geliştirmelerine olanak sağlamaktadır. Bu durum da bireyler iş olanaklarının ve kalkınmanın daha iyi olduğu ülkelere doğru eğilim göstermektedir. Bu anlamda sağlık harcamaları, eğitim harcamaları ve ekonomik büyümedeki artış göçü azaltmaktadır.

Ekonomik büyüme ve göç arasındaki ilişkinin boyutu ülkelerin aldığı/verdiği göç miktarına ve niteliğine bağlıdır. Nitelikli sermaye göçü ülkelerin ekonomik büyümesinde artış yaratırken, nüfus artışın düşük olduğu gelişmiş ülkelere doğru gerçekleşen kalifiye olmayan beşeri sermaye akımları da bu ülkelerin ekonomik büyümesini olumlu yönde etkilemektedir. Gelir dağılımı bir ülkede yaratılan mal ve hizmetlere dair toplam gelirin ve elde edilen refah artışının o ülkede yaşayan bireyler ve toplumsal sınıflar tarafından, ülkelerin gelişmesini olumsuz etkilenmektedir. Gelir dağılımı etkileri gözlemlendiğin de dağılımın eşit olmaması diğer ülkelere göç hareketliliğine sebep olmakta ve gelir dağılımı eşitsizliğinin arttığı ülkelerde, ekonomik büyüme yavaşlamakta ve sağlıklı yaşam koşullarına ulaşılması için gerekli olan hizmetlere ulaşılması zorlaşmaktadır. Temel ihtiyaçların rahat karşılandığını, sağlıklı bir ortamda yaşam sürdürüldüğünü ve gelişim için yeterli eğitim olanaklarından faydalandığını gösteren beşeri sermayedeki artış büyümeyi ve kalkınmayı olumlu yönde etkileyerek göç hareketliliğinde önemli olmaktadır.

5. KAYNAKÇA

Akbulut(2015). Kamu Gelirleri ve Kamu Harcamaları Nedensellik İlişkisi: 2006-2015 Dönemi İçin Türkiye Örneği Yıl 2016, Cilt 24, Sayı 27, Sf. 103 – 120.

Akdur(2016). Beşeri Sermayenin Büyüme Sürecindeki Rolü: Türkiye Örneği. Yüzüncü Yıl Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 2, 9-33.

Anderson, T.W. and Hsiao, C. (1981). Estimation of Dynamic Models with Error Components. Journal of the American Statistical Association, 76, 598–606.

Arellano, M. and Bond, S. (1991). Some Tests of Specification for Panel Data: Monte Carlo Evidence and an Application to Employment Equations. Review of Economic Studies, 58, 277-297.

Arellano, M. and Bover, O. (1995). Another Look at the Instrumental Variable Estimation of Error-components Models. Journal of Econometrics, 68, 29-51.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Atamtürk(2007). Eğitim Harcamaları, Ekonomik Büyüme ve Gelir Dağılımı İlişkisi, Yayınlanmamış Doktora Tezi, T.C. Sakarya Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, Sakarya.

Blundell, R. ve Bond, S. (1998). Dinamik Panel Veri Modellerinde Başlangıç Koşulları ve Moment Kısıtlamaları. *Blundell, Ekonometri Dergisi*, 87, sf. 115-143.

Blundell (2004). Initial Conditions and Moment Restrictions in Dynamic Panel Data Models.

Boswell, C. (2002). Addressing the Causes of Migratory and Refugee Movements : The Role of the European Union, (73).*Journal of Econometrics*, 87, sf. 115-143.

Cameron, A. C. and Trivedi P. K. (2005). *Microeconometrics, Methods and Applications*, New York: Cambridge University Press.

Castles, Manuel (2008). Ağ Toplumunun Yükselişi (İstanbul: İstanbul Bilgi Üniversitesi Yayınları No: 97) (Çev.: Ebru Kılıç).

Duman(2008). Gelişmekte Olan Ülkelerde Doğrudan Yabancı Yatırımlar-Ekonomik Büyüme İlişkisi Panel Veri Analizi, Yayınlanmamış Yüksek Lisans Tezi, T.C. Dokuz Eylül Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, İktisat Anabilim Dalı, İzmir.

Darbo(2017). Functional Income Distribution And Growth In South Korea: A Post Keynesian Econometric Analysis *Marmara Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi* Cilt: 39 Sayı: 2.

Darboe H. (2017). Göç ve Kalkınma: Gambiya Örneği *Marmara Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İktisat Anabilim Dalı Kalkınma İktisadi Ve İktisadi Büyüme Bilim Dalı Yüksek Lisans Tezi*.

Denison(1962). Education, Economic Growth and Gaps in Information. *The Journal of Political Economy*, sf. 124-128.Devlet Planlama Teşkilatı (2002).Türkiye.

Ecevit, E., & Çetin, M. (2016). Ekonomik Büyüme ve Çevre Kirliliğinin Sağlık Üzerindeki Etkisi: Türkiye İle İlgili Ampirik Kanıt. *Erciyes Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, sf. 83–98.

Hagen-zanker(2011). Health Care Expenditure and Income in the OECD Reconsidered: Evidence from Panel Data. *Economic Modelling*, sf. 804–811.

Karagül(2002). Beşeri Sermayenin Ekonomik Büyümeyle İlişkisi ve Etkin Kullanımı. *Akdeniz Üniversitesi İ.İ.B.F. Dergisi* (5), Antalya.

King, R. (2012). Theories and Typologies of Migration : An Overview and a Primer Willy Brandt Series of Working Papers in International Migration and Ethnic Relations Willy Brandt Series of Working Papers Editor. *Theories And Typologies Of Migration: An Overview And A Primer*.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Kar, M., Taban, S. (2004). Kamu Harcama Çeşitlerinin Ekonomik Büyüme Üzerine Etkileri, Ankara Üniversitesi SBF Dergisi, sf. 159-175.

Lucas, Robert E. (1988). On the Mechanics of Economic Development, Journal of Monetary Economics, S:22, sf.3-42.

Miller, T. (2002). An Approach to Forecasting Health Expenditures, with Application to the U.S. Medicare System, Health Services Research. 37(5), 1365-1386,

Nekelo (1991). Education, Externalities, Fertility and Economic Growth, Working Paper, Education and Employment, Population and Human Resources Department, The World Bank, November, WPS1039.

Niepelt (2007a). More Inequality and Fewer Opportunities? Structural Determinants and Human Agency in the Dynamics of Income distribution. pp. 216-251 in D.

Parkins, N. C. (2015). Push and Pull Factors of Latin American Migration. American Review of Political Economy, sf. 1-27.

Papastergoaddis (1999). Panel Verileri ve Gözlenemeyen Bireysel Etkiler. Econometrica, 49, 1029-1054

Roodman, D. (2006). An Introduction to Difference and System GMM in Stata Center for Global Development. Working Paper, 103.

Schultz(1961). Investment in Human Capital, The American Economic Review, S:51, C:1, ss.1-17.

Soto, M. (2009). System GMM Estimation with Small Sample, Barcelona: Institut d'Anàlisi Econòmica.

Tatoğlu, F. Y. (2012) Panel Veri Ekonometrisi, Beta Yayınları.

Taban S. Ve Kar M. (2004). Beşeri Sermaye ve Ekonomik Büyüme: Nedensellik Analizi, 1969-2001. Sosyal Bilimler Dergisi 2006.

Van Selm K, Sam DL, Van Oudenhoven JP (1997) "Life Satisfaction and Competence of Bosnian Refugees in Norway". Scand J Psychol, 143-149.

Yılmaz, Volkan ve Yentürk, Nurhan (2015) "Türkiye'de Sağlık Harcamalarına Tarihsel Bir Bakı", İstanbul Bilgi Üniversitesi, Sivil Toplum Çalışmaları Merkezi (STÇM): 1-17.

Wilsob (2004) "But the Young Men Don't Want to Farm Any More: Political Ecology and Consumer Culture in Belize", In Reimagining Political Ecology (der.) Aletta Biersack & James B. Greenberg: 149-170.

**BİLGİ TEKNOLOJİLERİ KULLANIM TATMİNİ, VERİMLİLİK VE YENİLİKÇİLİK
İLİŞKİSİ**

Meltem AKCA*

ÖZET

Son yıllarda bilgi teknolojilerinin çalışanların iş çıktıları üzerindeki etkisini araştıran çalışmalar akademik dünyada popüler hale gelmiştir. Birey açısından bilgi teknolojileri kullanımı ile kişinin görevlerini daha iyi ve hızlı bir şekilde yapması arzu edilmektedir. İşletmelerin bilgi teknolojilerine yönelik yatırım yapmasının altında yatan en önemli unsur faaliyetlerin ve çalışanların performansını artırma amacıdır. Bilgi teknolojilerine yönelik algı, teknolojilerin uygulanabilirliği ve kullanımı üzerinde rol oynamaktadır. Bilgi teknolojileri kullanım tatmini, iş ortamında kullanılan bilgi teknolojilerine yönelik bu teknolojileri kullanan kişilerin tutumlarıdır. Bilgi teknolojileri kullanım tatmini kavramı; kapsam, kesinlik, biçim, kullanım kolaylığı ve güncellik boyutlarından meydana gelmektedir.

Bu çalışmada bilgi teknolojileri kullanım tatmininin verimlilik ve yenilikçilik üzerindeki etkilerinin araştırılması amaçlanmıştır. Araştırma modelinin test edilmesinde Bilgi Teknolojilerine Yönelik Kullanıcı Tatmini Ölçeği (Doll ve Torkzadeh, 1988) ve Bilgi Teknolojileri Kullanımına Yönelik Verimlilik ve Yenilikçilik Ölçeği (Taraftar, Tu ve Ragu-Nathan, 2010) kullanılmıştır. Hazırlanan anket formları kartopu örnekleme yöntemi ile 254 kabin memurunun e-posta adreslerine gönderilmiştir. İlk olarak verilerin normal dağılım gösterme durumlarının ortaya çıkarılması amaçlanmıştır. Daha sonra varsayımlar ile uyumlu olarak araştırmada kullanılan ölçeklerin geçerlilik ve güvenilirliklerinin test edilmesinde IBM SPSS 21.00 programı kullanılacaktır. Ayrıca değişkenler arası ilişkilerin ortaya çıkarılmasında Pearson Korelasyon analizi ve Regresyon analizinden faydalanılacaktır. Araştırmada kartopu örneklem yöntemi kullanılması nedeniyle sonuçların bir havayolu işletmesi için genellenemeyeceği ancak kullanıcı dostu teknolojilere yönelik yapılacak yatırım kararları için önem arz edeceği beklenmektedir.

Anahtar Kelimeler: *Bilgi Teknolojileri Kullanım Tatmini, Performans, Yenilikçilik, Verimlilik, Kabin Memurları*

JEL Kodları: *M12, M15, M59*

* 1 İstanbul Üniversitesi, Ulaştırma ve Lojistik Fakültesi, İstanbul, meltemy@istanbul.edu.tr

**THE RELATIONSHIP BETWEEN INFORMATION TECHNOLOGIES END-USER
SATISFACTION, PRODUCTIVITY AND INNOVATION**

ABSTRACT

Studies that investigate the impact of information technologies on employees' job outcomes get popular in the academic world last years. On the individual perspective, it is expected to make jobs better and faster with the usage of information technologies. The significant and underlying factor for technological investments is to increase employees and operational performance with the usage of these technologies. The perception about information technologies play a significant role on the usage and implementation of technologies. Information technology end user satisfaction is attitudes of individuals who use these technologies in their work environment. The concept of information technologies end user satisfaction is comprised of content, accuracy, format, ease of use and timeliness dimensions (Doll, Xi &Torkzadeh, 1994).

In this study, it is aimed to analyse the impact of end-user satisfaction on employees' productivity and innovation. In order to test the research model it is used End-User Satisfaction Scale (Doll and Torkzadeh, 1988) and Information Technologies Productivity and Innovation Scale (Tarafdar, Tu ve Ragu-Nathan, 2010). Questionnaire forms sent to 254 cabin attendants' e-mail addresses with snowball sampling. Firstly, it is aimed to reveal out the normality distribution of data's. Later, accordance with assumptions, it is expected to use IBM Statistics SPSS 21.00 Programme to test the reliability, validity and factorial structures of variables. Furthermore, it is planned to use Pearson Correlation analyses and Regression tests to find out the relationship between variables. Due to the usage of snowball sampling method, results of the study will not be generalised for an airline company but will be beneficial and significant about investment decisions for user-friendly technologies in organisations.

Keywords: *End-User Satisfaction, Performance, Innovation, Productivity, Cabin Attendances*

Jel Codes: *M12, M15, M59.*

1.GİRİŞ

Teknolojinin gelişimi, organizasyonlarda bilgi teknolojileri kullanım alanlarını genişletmektedir. Teknoloji kullanımından beklenen fayda ve performans maksimizasyonu yönelimi, örgüt amaçları doğrultusunda bilgi teknolojileri kullanımına ilişkin kuramların oluşumuna zemin hazırlamıştır. Görev-Teknoloji Uyumu, Teknoloji Kabul Teorisi, Teknoloji Kullanımına Yönelik Kullanıcı Tatmini bu kuramlar arasında yer almaktadır. Bilimsel yazında, bu kuramların oluşumu çalışanların bilgi teknolojileri kullanımına yönelik algılarını ölçmede yeni araçların tasarlanmasında

etkili olmuştur. Bu kapsamda bu araştırmada kabin memurlarının mesleki faaliyetlerini yürütürken kullandıkları bilgi teknolojilerine yönelik kullanım tatmini algılarının bireysel performansın unsurları arasında yer alan inovasyon ve üretkenlik üzerinde etkili olup olmadığının ortaya çıkarılması amaçlanmıştır. Araştırma değişkenlerine ilişkin kavramsal çerçeve oluşturularak araştırma modeli kurulmuştur. Kabin memurlarından elde edilen veriler doğrultusunda yapılan istatistik analiz sonuçları yorumlanmıştır.

2.KAVRAMSAL ÇERÇEVE

Bilgi teknolojileri kullanım tatmini, iş hayatında kullanılan bilgi teknolojilerine yönelik bu teknolojileri kullanan kişilerin tutumlarıdır. Bilgi teknolojileri kullanım tatmini kavramı, kapsam, kesinlik, biçim, kullanım kolaylığı ve güncellik boyutlarından meydana gelmektedir (Doll ve Torkzadeh, 1999: 262). Bilgi teknolojilerinden elde edilen verilerin güvenilirliği, bilgi teknolojilerinin kullanım kolaylığı, bilgilerin rahat elde edilebilirliği, elde edilen bilgilerin doğruluğu, bilgi teknolojilerinin içeriği ve kapsamı bilgi teknolojileri kullanım tatmini üzerinde etkili olmaktadır (Heo ve Han, 2003:246). Ayrıca bilgi teknolojileri kullanım tatmini kavramı alt boyutlarından kapsam, kesinlik(doğruluk) ve güncellik bilgi teknolojileri kullanımının kullanılabilirliğini ifade eden unsurlardır (Somers, Nelson ve Karimi, 2003:598). Kullanıcı ihtiyaçlarını karşılayan bilgi teknolojileri uygulamaları kullanıcıların tatminini sağlamaktadır. Bilgi teknolojileri kullanımına yönelik tatmin de çalışan performansının artırılmasında oldukça önemlidir. Bilgi teknolojileri bireylerin işlerine yönelik faaliyetlerini yürütmek için ihtiyaç duyulan bilgiyi sağlıyorsa bu durum performans artışını tetikleyecektir. Bilgi teknolojileri kullanım tatmini iş hayatında sürekli olarak bilgi teknolojileri uygulamalarını kullanan çalışanlar için çok daha önemli bir kavram olarak ele alınmaktadır (Gelderman, 1998:13).

Bilgi teknolojileri tarafından sunulan bilginin kalitesi, içeriği, yeterliliği kapsam boyutu altında ele alınmaktadır. Kullanılan teknolojilerin faaliyetlerin yürütülmesine olanak tanıyacak kapsamlı bilgileri sunması önem arz etmektedir. Gereksiz bilgilerin raporlanması, eksik bilgi aktarılması kullanım tatmini algısını zayıflatacak unsurlardır. Bilgi teknolojileri tarafından sağlanan bilgilerin içeriğinin kullanılabilir olması çalışanın bilgi teknolojileri kullanım istekliliğini arttıracak ve kullanıcı tatmin algısını yükseltecektir (Akca,2016:109). Faaliyetlerin gerçekleştirilmesinde bilgi teknolojileri yoğun çaba harcanmadan işleri kolaylaştırabiliyorsa bilgi teknolojilerine yönelik kullanım kolaylığından bahsedilmektedir. Daha az çaba ile kolay olarak işleri başarmak kullanım kolaylığını betimlemektedir (Wallace ve Sheetz, 2014:250). Bilgi teknolojilerinden elde edilen bilgilerin hatasız olması kesinlik boyutunu tanımlamaktadır. Bilgi teknolojilerinin doğruluğu, güvenilirliği sunduğu bilgilerin kesinliği ile açıklanabilmektedir. Bilgi teknolojileri uygulamalarından aktarılan bilgilerin kesin olması ve hata payı içermemesi çalışan faaliyetlerinin başarı ile sonuçlanması üzerinde etkili olmaktadır. Bilgi teknolojileri kullanımı ile çalışanların ihtiyaç duydukları zamanda istedikleri en güncel bilgileri elde

etmesi bilgi teknolojilerinin güncelliği ile ilişkilidir. Güncel bilgilerin elde edilmesinin sağlanmasında bilgi teknolojilerinin güvenilirliğinin yüksek olması da önem arz etmektedir (Akca, 2016:112-113).Çalışanlar; bilgi teknolojilerini kullanarak bireysel performanslarının gelişeceğine inanıyorlarsa algılanan kullanışlılık kavramından bahsedilmektedir. Kullanışlılık kavramı, çalışanın teknolojiyi kullanarak yaptığı işlerde daha yüksek performans göstereceği beklentisi ile oluşan düşünceleridir (Davis,1989:320).

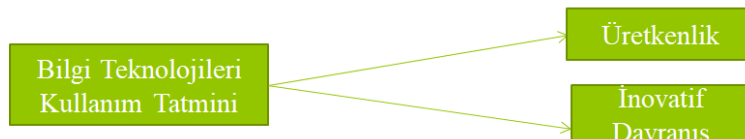
Çalışanların iş hayatındaki faaliyetlerini icra ederken iş rutinlerini ve örgütsel süreçleri inovatif iş davranışları ile bütünleştirebilen teknolojiler, çalışan tatmininde önemli rol oynamaktadır. Bilgi teknolojilerine yönelik inovasyon; kullanılan teknoloji uygulamaları sonucunda yaratıcı olma, yeni fikirler üretme, iş akışına yeni bir yön verme gibi çalışan davranışları üzerinde belirleyici olabilmektedir (Taraftar, Tu ve Nathan, 2010: 315). Bireysel performans unsurları arasında yer alan üretkenlik ve inovatif davranış boyutları da bilgi teknolojileri kullanım tatmini ile ilişkili olabilecek unsurlar olarak değerlendirilmektedir.

3. METODOLOJİ

3.1. Araştırmanın Yöntemi

Bu araştırmanın amacı havacılık sektöründe kullanılan bilgi teknolojilerinin kabin memurlarının üretkenliği ve inovatif davranışları üzerinde etkili olup olmadığını ortaya çıkarmaktır. Araştırmanın amacını gerçekleştirmek için hazırlanan soru formunda Doll, Xi ve Torkzadeh (1994) tarafından geliştirilen bilgi teknolojileri kullanım tatmini ölçeği ile Taraftar, Tu ve Ragu-Nathan (2010) tarafından geliştirilen bilgi teknolojilerine yönelik üretkenlik ve inovatif davranış ölçeklerinden faydalanılmıştır. Kartopu örnekleme yöntemi ile 254 kabin memuruna gönderilen anketlerden elde edilen 201 anket verisi IBM Statistics SPSS 21.00 programı ve Lisrel 8.8 Scientific Software International Programı üzerinde analiz edilmiştir.

Resim 1. Araştırma Modeli



H₁=Bilgi teknolojileri kullanım tatmini ve üretkenlik arasında pozitif yönlü bir ilişki vardır.

H₂=Bilgi teknolojileri kullanım tatmini ve inovatif davranışlar arasında pozitif yönlü bir ilişki vardır.

3.2. Araştırma Bulguları

201 kabin memurundan elde edilen verilerin normallik testleri yapılmış ve verilerin parametrik analizler için uygun olduğu saptanmıştır. Araştırmada kullanılan ölçeklerin güvenilirliği Cronbach Alpha's katsayısı ile değerlendirilmiştir. Bilgi teknolojileri kullanım tatmini ölçeği iç tutarlılık katsayısı 0.78, bilgi teknolojileri üretkenlik boyutu iç tutarlılık katsayısı 0.86 ve bilgi teknolojilerine yönelik inovatif davranış boyutu iç tutarlılık katsayısı 0.83 olarak hesaplanmıştır. 0.70 ve üzeri olan değerlerin tutarlı olarak kabul edildiği göz önüne alındığında araştırmada kullanılan ölçeklerin güvenilir olduğu sonucuna ulaşılmaktadır. Araştırmada kullanılan ölçeklerin ortalamalarına ilişkin bulgular değerlendirildiğinde; bilgi teknolojileri kullanım tatmini ortalaması 3.05, üretkenlik boyutu ortalaması 3.57 ve inovatif davranışların ortalaması 3.14 olarak hesaplanmıştır. Araştırma modeli değişkenleri arasındaki ilişkiler korelasyon analizi ile ortaya çıkarılmıştır. Değişkenler arası ilişkilerde Pearson Korelasyon katsayısı dikkate alınmıştır. Bu kapsamda; bilgi teknolojileri kullanım tatmini ile üretkenlik arasında orta düzey ve istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki ($r=0.476$), bilgi teknolojileri kullanım tatmini ile inovatif davranış arasında orta düzey ve istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki ($r=0.389$), üretkenlik ve inovatif davranış arasında da orta düzey ve istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki olduğu saptanmıştır ($r=0.389$). Araştırmada kullanılan ölçeklerin yapı geçerliliği ise Doğrulayıcı Faktör Analizi ile Lisrel 8.8 Scientific Software International Programı üzerinde analiz edilmiştir. Analiz sonucunda kullanılan ölçeklerin uyum iyilik değerlerinin kabul edilebilir aralık içerisinde olduğu ortaya çıkarılmıştır.

Tablo 1. Doğrulayıcı Faktör Analizi Sonuçları

| | χ^2 | df | χ^2/df | RMSEA | TLI | IFI | CFI | Faktör Yükleri |
|---------------------|----------|----|-------------|-------|------|------|------|----------------|
| BT Kullanım Tatmini | 345.27* | 84 | 4,11 | 0.04 | 0.97 | 0.98 | 0.96 | 0.66-0.73 |
| Üretkenlik | 284.65* | 72 | 3,95 | 0.07 | 0.99 | 0.95 | 0.97 | 0.72-0.79 |
| İnovatif Davranış | 211.58* | 61 | 3,46 | 0.06 | 0.98 | 0.99 | 0.98 | 0.71-0.88 |

Araştırma hipotezlerinin test edilmesi amacıyla yapılan regresyon analizi sonuçları aşağıdaki tabloda yer almaktadır.

Tablo 2. Regresyon Analizi Sonuçları

| Bağımsız Değişken: | <i>Beta</i> | <i>t</i> | <i>p</i> |
|--|-------------|----------|----------|
| Bağımlı Değişken: Üretkenlik | | | |
| Bağımsız Değişken: BT Kullanım Tatmini | 0.476 | 10.335 | 0.000 |
| | R^2 | F: | <i>p</i> |
| | 0.319 | 100.886 | 0.000 |
| Bağımlı Değişken: İnovatif Davranışlar | | | |
| Bağımsız Değişken: BT Kullanım Tatmini | 0.389 | 9.774 | 0.000 |
| | R^2 | F: | <i>p</i> |
| | 0.207 | 76.110 | 0.000 |

Bağımsız değişken ile bağımlı değişkenler arasındaki pozitif etki katsayılarının 0.476 ve 0.389 olduğu görülmektedir. Basit regresyon analizlerinde bu değer genellikle korelasyon katsayısı ile aynı çıkmaktadır. P değerleri incelendiğinde modelin anlamlı olduğu sonucuna ulaşılmaktadır. R^2 değerleri incelendiğinde ise; üretkenlik üzerindeki değişimin %31.9'luk bölümünün bilgi teknolojileri kullanım tatmini ile açıklanabileceği sonucu elde edilmektedir. Aynı şekilde inovatif davranışlar üzerindeki değişimin de %20.7'lik bir bölümü bilgi teknolojileri kullanım tatmini ile açıklanmaktadır. Araştırma sonuçlarına göre kurulan hipotezlerin kabul edildiğini söylemek mümkündür.

SONUÇ

Günümüz organizasyonlarında bilgi teknolojileri kullanımının en önemli amaçlarından biri çalışan performansını arttırmaktır. Bu amaç doğrultusunda kullanılan bilgi teknolojilerinin kullanıcı dostu olması ve çalışanlar tarafından benimsenmesi de önem arz etmektedir. Havacılık sektörü de teknoloji yoğun sistemlerin kullanıldığı bir sektördür. Bu araştırmada kabin memurlarının kullandığı bilgi teknolojileri kullanım tatmininin bireysel performans unsurları arasında yer alabilecek üretkenlik ve inovatif davranış üzerinde etkili olup olmadığının ortaya çıkarılması hedeflenmiştir. Araştırma kapsamında yapılan analizler sonucunda çalışanların bilgi teknolojilerine yönelik kullanım tatmini algısının üretkenlik ve inovatif davranış üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif bir etkiye sahip olduğu sonucuna ulaşılmıştır.

KAYNAKÇA

- Akca, M.(2016) “Havalimanı Yeri, Çalışma Koşulları ve Bilgi Teknolojileri Kullanımının Trafik Kontrolörü Performansına Etkisi: Bir Alan Araştırması”, İstanbul Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Yayınlanmamış Doktora Tezi.
- Davis, F. D. (1989) “Perceived Usefulness, Perceived Ease of Use, and User Acceptance of Information Technology”, *MIS quarterly*: 319-340.
- Doll, W. J., Xia, W., & Torkzadeh, G. (1994) “A Confirmatory Factor Analysis of the End-user Computing Satisfaction Instrument”, *MIS quarterly*: 453-461.
- Gelderman, M. (1998) “The Relation Between User Satisfaction, Usage of Information Systems and Performance”. *Information & Management*, 34(1): 11-18.
- Heo, J., & Han, I. (2003) “Performance Measure of Information Systems (IS) in Evolving Computing Environments: An Empirical Investigation”, *Information & Management*, 40(4): 243-256.
- Somers, T. M., Nelson, K., & Karimi, J. (2003) “Confirmatory Factor Analysis of the End-user Computing Satisfaction Instrument: Replication within an ERP Domain”, *Decision Sciences*, 34(3): 595-621.
- Torkzadeh, G., & Doll, W. J. (1999). “The Development of a Tool for Measuring the Perceived Impact of Information Technology on Work”, *Omega*, 27(3): 327-339.
- Tarafdar, M., Tu, Q., & Ragu-Nathan, T. S. (2010) “Impact of Technostress on End-user Satisfaction and Performance”, *Journal of Management Information Systems*, 27(3): 303-334.
- Wallace, L. G., & Sheetz, S. D. (2014) “The Adoption of Software Measures: A Technology Acceptance Model (TAM) Perspective”, *Information & Management*, 51(2): 249-259.

**REEL DÖVİZ KURUNUN FARKLI ÜLKE GRUPLARINDAN GELEN TURİST SAYILARI
ÜZERİNDEKİ ETKİSİNİN İNCELENMESİ: TÜRKİYE ÜZERİNE BİR UYGULAMA**

Prof.Dr.M.Öğuzhan İLBAN*

Dr.Öğr.Üyesi Sevgi SEZER**

Araş.Gör.M.Tahsin LİCELİ***

ÖZET

Bu çalışmanın amacı reel efektif döviz kurunun farklı ülke gruplarından Türkiye'ye gelen turist sayıları üzerinde etkisi olup olmadığını kısa ve uzun dönemde incelemektir. Bu bağlamda Ocak 2003–Aralık 2017 dönemi için aylık frekanstaki verilerden yararlanarak eşbütünleşme, hata düzeltme modeli ve hata düzeltme modeline bağlı nedensellik analizleri gerçekleştirilmiştir. Gerçekleştirilen analiz sonuçları, Doğu Asya ülke grubu istisna olmak üzere, uzun dönemde tüm ülke gruplarından Türkiye'ye gelen turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasındaki negatif yönlü nedensellik ilişkisini ortaya koymaktadır. Ancak kısa dönem için istatistiksel olarak anlamlı bir nedensellik ilişkisi olmadığını sonucuna varılmıştır. Diğer bir ifadeyle, kısa dönemde döviz kuru değişimlerinin gelen turist sayıları üzerinde herhangi bir etkisinin olmadığı tespit edilmiştir.

Anahtar Kelimeler: Reel Döviz Kuru, Gelen Turist Sayıları, Türkiye

**INVESTIGATING THE IMPACTS OF REAL EXCHANGE RATES ON THE NUMBER OF
TOURIST ARRIVALS TO TURKEY FROM DIFFERENT COUNTRY GROUPS: AN
APPLICATION ON TURKEY**

ABSTRACT

This study aims to determine whether or not the real effective exchange rates have any impact on the number of tourist arrivals to Turkey from different country groups either in the short- or the long-run. In this context; cointegration, error correction model and causality analyses related to error correction model are performed by using data in monthly frequency over the period January 2003-December 2017. The results of the analysis performed, with the exception of East Asia group, reveal the existence of a long-term negative causal relationship between the real effective exchange rates and the number of tourist arrivals to Turkey from all country groups. Nonetheless, it is concluded that there is

* Prof.Dr. M.Öğuzhan İLBAN, Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Gastronomi ve Mutfak Sanatları Bölüm Başkanı, e-mail: ilban@balikesir.edu.tr

** Dr.Öğr.Üyesi Sevgi SEZER, Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Bankacılık ve Finans Bölümü, e-mail: sevgi.sezer@balikesir.edu.tr

*** Araş.Gör.M.Tahsin LİCELİ, Balıkesir Üniversitesi, Burhaniye Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Turizm İşletmeciliği ve Otelcilik Bölümü, e-mail: liceli@balikesir.edu.tr

no statistically significant causal relationship in the short-run. In other words, it is determined that the exchange rate changes have no short-term impact on the number of tourists.

Keywords: *Real Exchange Rates, Number of Tourist Arrivals, Turkey*

1.GİRİŞ

Turizm; döviz gelirleri, yeni iş ve istihdam olanakları ve vergi gelirleri üzerindeki etkisi ile ekonomik büyüme ve kalkınmayı teşvik eden önemli kaynaklardan biridir (Farver, 1984; Göymen, 2000; Belloumi, 2010). Birçok gelişmekte olan ülke ekonomisi, sürdürülebilir bir ekonomik büyümeyi mümkün kılmak için dünyanın üçüncü büyük endüstrisi olarak anılan turizm alanında yatırımlar gerçekleştirmektedir (Sinclair, 1998). Turizm yarattığı katma değer ve gelişme potansiyeli ile ulusal ekonomilerde artan bir konuma sahip olan “dumansız endüstri” olarak bilinmektedir (Henderson, 2001; Leiper, 2008).

Devamlılık arz eden gelişme, genişleme ve çeşitlendirme ile turizm geçtiğimiz birkaç on yılda dünyadaki en büyük ve en hızlı büyüyen ekonomik sektörlerden biri ve en büyük hizmet sektörü haline gelmiştir. 2018 Yılı Dünya Turizmi Ekonomik Eğilimler Raporu’na göre, küresel anlamda gelen turist sayıları, 2017 yılında yaklaşık 11.9 milyar (dünya nüfusunun 1.6 katı) gibi rekor bir düzeye ulaşmıştır. Küresel turizm geliri, 2018 yılının üçüncü çeyreği itibarıyla, küresel gayri safi yurtiçi hasılanın (GSYİH)% 6.8’ine denk gelecek biçimde 5.6 trilyon ABD Doları’na ulaşmıştır.

Küresel turist nüfusunun büyüme oranı ve toplam turizm gelirleri, küresel GSYİH büyüme oranından önemli ölçüde daha yüksektir. Turizm, sosyo-ekonomik kalkınmanın en önemli itici güçlerinden biri olan ihracat gelirleri, iş ve işletmelerin oluşturulması ve sosyo-ekonomik ilerlemeyi teşvik etmek amacıyla altyapı geliştirmesi ile sağlanmaktadır (Paramati et al., 2017). Bu da, turizmin bir ülkeye büyük iş fırsatları getirebileceğini ve ekonomik büyümesini destekleyebileceğini göstermektedir (Chiu ve Yeh, 2017). Sonuç olarak, turizmin ekonomik etkisi hükümetlerin artan ilgisini çektiğinden, son yıllarda turizm ve diğer makroekonomik değişkenler ile ilgili araştırmalar artmaktadır (De Vita ve Kyaw, 2013; Tang ve diğ., 2016; Stettler, 2017). Konuyla ilgili kuramsal ilişkileri ortaya koyan Webber (2001) çalışmasında turizmin, döviz kurundan etkilenme olasılığı olan belirli bir mal olduğunu belirtmiş ve bu etkinin teorik olarak iki farklı şekilde ortaya çıkabileceğini ileri sürmüştür. Buna göre ilk olarak, döviz kurundaki dalgalanmalar uluslararası turist varış noktası tercihini etkileyebilecektir çünkü turistler döviz kurunun daha uygun olduğu ülkeleri tercih etme eğilimindedir. İkinci olarak ise ziyaret edilen ülke para birimi değer kaybettiğinde, uluslararası turistlerin harcama yapmak için daha fazla parası vardır ve bu nedenle, kalış sürelerini uzatabilir ve harcamaları arttırabilirler (Crouch, 1993). Görünen odur ki, bir ülkenin para birimine uygulana devalüasyon veya paranın serbest piyasada değer kaybı gelen turist sayısının artmasına yol açıyor gibi görünse de, bu konuyla ilgili araştırmalar kesin bir ilişkinin varlığını ortaya koyamamaktadır.

Bu çalışmanın amacı farklı ülke gruplarından Türkiye'ye gelen turist sayılarının kısa ve uzun dönemde döviz kuru değişiminden etkilenip etkilenmediğini ortaya koymaktır. Bu bağlamda çalışma beş bölümden oluşmaktadır. İlk bölümde konuya giriş yapılmış ikinci bölümde ise konuyla ilgili literatüre yer verilmiştir. Üçüncü bölümde analizlerde kullanılan veri ve yöntem açıklanmıştır. Dördüncü bölümde ise elde edilen bulgulara yer verilmiştir. Son bölüm ise genel bir değerlendirmeden oluşmaktadır.

2.KONUyla İLGİLİ ÇALIŞMALAR

Döviz kuru ile turizm arasındaki ilişkiyi inceleyen çok sayıda çalışma mevcuttur. Ancak bu çalışmada uygulanan metodolojiye benzer nitelikte uygulama gerçekleştiren veya farklı ülkelerden gelen turist sayılarını inceleyen çalışma sayısı görece olarak sınırlıdır. Bu bağlamda incelenen çeşitli çalışmalara aşağıda yer verilmiştir.

Bahar (2007) çalışmasında, 1980 sonrası Türkiye'de yaşanan devalüasyonların turizm sektörü üzerinde herhangi bir olumlu veya olumsuz etki yaratıp yaratmadığını incelenmiştir. Bu amaçla, gelen turist sayısının devalüasyonlardan etkilenip etkilenmediği; ülkeye gelen turist sayısı, Amerikan Doları ve Alman Mark'ından oluşan bir para birimi sepeti ve devalüasyon uygulanan yıllar için bir kukla değişken kullanılarak 1980-2005 yılları arasında analiz edilmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar ülkedeki devalüasyonların gelen turist sayısını artırdığını ortaya koymaktadır.

Demirel ve diğ. (2008) çalışmasında; Türkiye'ye en çok turist gönderen ülkeler arasında bulunan ABD, Almanya, Fransa ve İngiltere'den gelen turist sayısı üzerinde döviz kuru dalgalanmalarının olası etkisi 1994-2006 yılları arasındaki dönem için incelenmiştir. Çalışmanın üçer aylık verileri TCMB ve IMF veritabanından elde edilmiştir. Elde edilen sonuçlara göre; Fransa için reel döviz kuru değişiklikleri, ülkeye gelen turist sayısı üzerinde olumsuz etki yaratmıştır. Reel döviz kuru belirsizliği açısından incelendiğinde, Fransa dışındaki ülkelerde reel döviz kuru belirsizliklerinin, turist sayısının üzerinde herhangi bir etkisi olmadığı sonucuna ulaşılmıştır.

Kuo ve diğ. (2010) çalışmasının temel amacı, Asya ve Pasifik ülkelerindeki uluslararası turizm talebi ile döviz kuru arasındaki bağımlılık yapısının toplu veri ölçümlerini aylık verilere dayanarak Copula yöntemi yardımıyla incelemektir. Çalışmada kullanılan veriler Turizm Bürosu online istatistik veritabanlarından elde edilen sekiz Asya ülkesinin (Japonya, Çin, Kore, Tayvan, Hong Kong, Singapur, Malezya ve Tayland) turist sayıları ve döviz kurlarının Ocak 2001- Temmuz 2007 dönemi için aylık verilerinden oluşmaktadır. Çalışmadan elde edilen ampirik sonuçlara göre, uluslararası turist sayısı ve döviz kuru arasındaki negatif ilişki olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Ayrıca yerel paranın değer kazanmasının turizm talebi üzerindeki etkisinin, para birimindeki değer kaybından daha fazla olduğu ortaya konulmuştur.

Quadri ve Zheng (2010) çalışmasında döviz kurlarının İtalya'ya gelen uluslararası turist sayısı üzerindeki etkisi incelenmiştir. İlgili çalışmada 19 ayrı ülkeden İtalya'ya gelen turist sayıları ile döviz kuru arasındaki ilişki 2004-2009 yılları arasındaki dönemi için regresyon analizi yardımıyla incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, döviz kurlarının gelen turist sayısı üzerindeki etkisinin sınırlı olduğunu ve incelenen 19 ülkeden sadece 8'inde anlamlı sonuçlara ulaşıldığını ortaya koymaktadır. Bu sonuç döviz kurlarının evrensel anlamda turizm talebini etkilemediğini ortaya koymaktadır.

Uğuz ve Topbaş (2011) çalışmasında, Türkiye için döviz kuru oynaklığı ve turizm talebi arasındaki ilişki, 1990-2010 dönemine ait aylık turizm gelirleri ve döviz kuru verileri kullanılarak incelenmiştir. İlgili çalışmada EGARCH modelinin yardımıyla aylık döviz kuru oynaklığı tespit edilmiş ve Johansen eşbütünleşme analizi çerçevesinde döviz kuru oynaklığı ve turizm talebi etkileşimi incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, turizm talebinin uzun dönemde döviz kuru ve döviz kuru oynaklığı ile istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki içinde olduğu göstermektedir.

Chang ve McAleer (2012) çalışmasında Tayvan için önde gelen iki turizm ülkesi olan Japonya ve ABD'den gelen turist sayısı ve turizm geliri ile Yen/Yeni Tayvan Doları, ABD Doları/Yeni Tayvan Doları kurları arasındaki ilişki incelenmiştir. İlgili çalışmada döviz kuru oynaklığının GARCH ve EGARCH modellemesi için 1 Ocak 1990 - 31 Aralık 2008 arası döneme ait günlük verilerden yararlanılmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlara göre, döviz kuru ve döviz kuru oynaklığı etkilerinin farklı olduğu tespit edilmiştir. Ayrıca döviz kurundaki artışların Tayvan'a gelen turist sayısı üzerinde olumsuz etkiye sahip olduğu ancak, döviz kuru oynaklığının Tayvan'a gelen turistler üzerinde olumlu veya olumsuz etkileri olabileceği sonucuna ulaşılmıştır.

Tang (2013) çalışmasında 1974-2009 arası dönem için Malezya'daki reel turizm gelirleri, reel gelir ve reel döviz kurları arasındaki dinamik ilişkiyi analiz etmek amacıyla sınır testi yaklaşımı ve hata düzeltme modellemesi uygulanmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, değişkenler arasında uzun dönemli bir ilişki olduğunu ortaya koymaktadır. Kısa dönemde ise, reel turizm gelirleri ile reel gelir arasında Granger nedensellik bulunmazken, uzun dönemde iki yönlü bir nedensellik olduğu tespit edilmiştir. Çalışmada ayrıca, hem kısa hem de uzun dönemde reel döviz kurlarından reel turizm gelirlerine doğru tek yönlü nedensellik bulunmuştur.

Agiomirgianakis ve diğ. (2014) çalışmasında, 1994-2012 dönemi için döviz kuru volatilitésinin Türkiye'ye gelen turist sayısı üzerindeki etkileri incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, döviz kurundaki dalgalanma ve turist girişleri arasında negatif bir ilişki olduğunu ortaya koymaktadır. Ayrıca nispeten pahalı yerler ile alternatif lokasyonlar arasındaki rekabet göz önüne alındığında, nispeten pahalı yerlerin turistleri caydırdığını gösteren nispi fiyat oranının ülkeye turist girişine olumsuz etkisi olduğu tespit edilmiştir.

Agiomirgianakis ve diğ. (2015) çalışmasında iki AB üyesi ülke olan İngiltere ve İsveç arasındaki turizm akışları ve döviz kuru oynaklığı arasındaki ilişki 1990-2012 yılları arasındaki dönem için incelenmiştir. Çalışmada eşbütünleşme ve hata düzeltme modelleri uygulanmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlar, İngiltere ve İsveç'e yönelik turist akışları ile döviz kurundaki dalgalanma arasında negatif bir ilişki olduğunu ve hem nispi fiyat oranının hem de reel milli gelirin turist akışları üzerinde etkisi olduğunu ortaya koymaktadır.

Samırkaş ve Samırkaş (2015) çalışmasında 2003-2012 dönemi için Johansen eşbütünleşme testi ve Granger nedensellik testi kullanılarak Türkiye'de döviz kuru ve turizm talebi arasındaki ilişki incelenmiştir. Çalışma sonucunda turist başına turizm gelirleri ve reel döviz kuru arasında uzun vadeli ilişki bulunmaktadır. Ayrıca reel döviz kuru ve Türkiye'ye gelen turist başına turizm geliri arasında nedensellik ilişkisi mevcuttur. Çalışmada özellikle İngiliz Sterlin'i ile İngiltere'den gelen turist sayısı arasında önemli bir eşbütünleşme ilişkisinin varlığı tespit edilmiştir.

Kiang ve diğ. (2015) çalışmasında, Ocak 2007- Mart 2015 dönemi arasında döviz kurunun; Tayland turist sayısı, toplam 14 ülkedeki (Çin, Hong Kong, Japonya, G.Kore, Tayvan ve 9 Güney Asya ülkesi) döviz kurları ve gelen turist sayısı arasındaki ilişki Çoklu Regresyon ve Panel Veri Analiz yöntemiyle incelenmiştir. Çalışmadan elde edilen sonuçlar gecikmeli turist sayısının ve döviz kurlarının gelen turist sayısı ile anlamlı bir ilişkisi olduğunu ortaya koymaktadır. Ayrıca döviz kurunun Tayland'a gelen turist sayısını etkilediği sonucuna ulaşılmıştır. İlgili çalışmada her bir ülke ayrı ayrı incelenerek, döviz kurunun belirli ülkeler üzerinde etkisi olduğu sonucuna varılmıştır. Çalışmada döviz kurunun gelen turist sayısını etkilemediği ülkeler için bir saptama geliştirilmiştir. Buna göre turistlerin önceden gezileri planlaması yaygındır, bu nedenle döviz kuru her zaman mevcut gelen turist sayılarını etkilemeyebilir.

Bozkurt ve Pekmezci (2015) çalışmasında Türk turizm sektörüne yönelik talep ve döviz kuru şokları arasındaki ilişki teorik ve ampirik olarak analiz edilmiştir. Bu bağlamda, turist sayısının standart hatası ve standart döviz kuru hatası, Ocak 1996 ve Eylül 2012 için talep şoku ve döviz kuru şokunun bir göstergesi olarak kullanılmıştır. Çalışmadan elde edilen sonuçlar turizm talebi şoku ile döviz kuru şoku arasında negatif uzun vadeli bir ilişki olduğu sonucunu ortaya koymaktadır.

Wang ve Tang (2018) çalışmasında 2008-2014 dönemi için Pekin'de gelen turist sayısının Yuan kuru oynaklığından etkilenip etkilenmediği incelenmiştir. Çalışmada eşbütünleşme testi ve Granger nedensellik testi kullanılarak gerçekleştirilen analiz sonuçları, Yuan'ın değer kazanmasının gelen turist sayısı üzerindeki olumsuz etkisinin 2011'in sonundan itibaren geliştiği göstermektedir. Ayrıca Yuan kuru oynaklığının, Pekin'in gelen turist sayısı üzerinde gecikmeli bir etkiye sahip olduğu ifade edilmiştir.

3. VERİ VE YÖNTEM

Analizlerde kullanılan verilerden ilki Türkiye İstatistik Kurumu (TÜİK) turizm istatistikleri, turizm ve sınır istatistikleri listesinden, giriş çıkış yapan ziyaretçiler içerisinde yer alan, ülke gruplarına göre giriş yapan turist istatistiklerinden derlenmiştir. Ülke gruplarına göre giriş yapan turist istatistiklerine ilişkin hesaplamaların ulaşılabilir olduğu ilk dönem Ocak 1996'dır. TÜİK tasnifine göre ilgili ülke grupları ve örnekleme yer alan ülkeler ve ilgili gruplar için kullanılacak kısaltmalar Tablo 1'de görülebilir.

Tablo 1. Analizlere Dâhil Edilen Ülke Grupları ve Kapsamındaki Ülkeler

| Ülke Grubu | Kısaltma | Ülkeler |
|------------------------------|----------|--|
| Afrika Ülkeleri | AFRK | Cezayir, Fas, Güney Afrika Cumhuriyeti, Kenya, Libya, Mısır, Nijerya, Senegal, Sudan, Tunus, Diğer Afrika Ülkeleri. |
| Amerika Ülkeleri | AMRK | Arjantin, Brezilya, Dominik Cumhuriyeti, Ekvator, Kolombiya, Panama, Paraguay, Peru, Şili, Uruguay, Venezuela, Diğer Amerika Ülkeleri. |
| Avrupa OECD Ülkeleri | AVOEC | Almanya, Avusturya, Belçika, Çek Cumhuriyeti, Danimarka, Finlandiya, Fransa, Hollanda, İngiltere, İrlanda, İspanya, İsveç, İsviçre, İtalya, İzlanda, Lüksemburg, Macaristan, Norveç, Polonya, Portekiz, Slovakya, Yunanistan |
| Bağımsız Devletler Topluluğu | BADETO | Azerbaycan, Beyaz Rusya, Ermenistan, Gürcistan, Kazakistan, Kırgızistan, Moldova Cumhuriyeti, Özbekistan, Rusya Federasyonu, Tacikistan, Türkmenistan, Ukrayna. |
| Batı Asya Ülkeleri | BATAS | Birleşik Arap Emirlikleri, Bahreyn, Filistin, Irak, İsrail, Katar, Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti, Kuveyt, Lübnan, Suriye, Suudi Arabistan, Umman, Ürdün, Yemen. |
| Diğer Avrupa Ülkeleri | DAVRU | Arnavutluk, Bosna Hersek, Bulgaristan, Estonya, Hırvatistan, Letonya, Litvanya, Makedonya, Romanya, Sırbistan, Slovenya, Diğer Avrupa Ülkeleri. |
| Diğer OECD Ülkeleri | DOECD | ABD, Avustralya, Japonya, Kanada, Kore, Meksika, Yeni Zelanda. |
| Doğu Asya Ülkeleri | DASYA | Çin, Hong Kong, Diğer Doğu Asya Ülkeleri. |
| Güney Asya Ülkeleri | GAYSA | Afganistan, Bangladeş, Hindistan, İran, Pakistan, Diğer Güney Asya Ülkeleri. |
| Güneydoğu Asya Ülkeleri | GDASYA | Endonezya, Filipinler, Malezya, Singapur, Tayland, Diğer Güneydoğu Asya Ülkeleri. |

Analizlerde kullanılacak bir diğer veri olan reel efektif döviz kuru endeksi, nominal efektif döviz kuru kullanılarak hesaplanmaktadır. Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası (TCMB) tanımına göre Nominal efektif döviz kuru, Türkiye'nin dış ticaretinde önemli paya sahip ülkelerin para birimlerinden oluşan sepete göre, Türk Lirası (TL)'nin ağırlıklı ortalama değeridir. Ağırlıklar ikili ticaret akımları kullanılarak belirlenmektedir. Reel efektif döviz kuru ise nominal efektif döviz kurundaki nispi fiyat etkileri arındırılarak elde edilmektedir. TCMB tarafından hesaplanan reel efektif döviz kuru endeksleri ülkemiz fiyat düzeyinin dış ticaret yapılan ülkelerin fiyat düzeylerine oranının ağırlıklı geometrik ortalaması alınarak hesaplanmaktadır (<http://www.tcmb.gov.tr>). İlgili kurun hesaplanma yöntemi aşağıdaki gibi ifade edilebilir:

$$REK = \prod_{i=1}^N \left[\frac{P_{TUR}}{P_i * e_{i,TUR}} \right]^{w_i} \quad (1)$$

Denklemden yer alan w_i "i" ülkesinin Türkiye'nin reel efektif döviz kuru endeksindeki ağırlığını, P_{TUR} Türkiye'nin fiyat endeksini, P_i "i" ülkesinin fiyat endeksini, $e_{i,TUR}$ "i" ülkesinin parasının TL cinsinden kur değerini ve N ülke sayısını göstermektedir. Denklemden reel efektif kurun artışı TL'nin reel olarak değer kazandığını, diğer bir anlatımla Türk mallarının yabancı mallar cinsinden fiyatının arttığını göstermektedir. Reel efektif döviz kuru endeksi verisinin hesaplanmaya başlandığı ilk dönem Ocak 2003'tür.

Mevcut veri seti ve ulaşılabilen tüm bilgiler değerlendirildiğinde bu çalışmada çeşitli kısıtlar bulunmaktadır. Buna göre ilk kısıt, veri yapısından kaynaklı olarak analizler, ülkeler üzerine değil, ülke grupları üzerine gerçekleştirilmiş ve ilgili ülke grupları ise TÜİK tarafından belirlenmiştir. Ayrıca TÜİK sınıflandırmasında bulunan ancak verisinin kesintili olması ve diğer verilere kıyasla oldukça düşük olması nedeniyle Milliyetsizler ve Okyanusya ülkeleri analizlere dâhil edilmemiştir. Bunun dışında çalışma dönemi en geniş veri seti ile gerçekleştirilmek amaçlanmıştır. Buna göre her iki veri setinin de ortak olarak ulaşılabildiği ilk dönem Ocak 2003'tür. Ayrıca tam bir yıllık döngüyü kapsamaması açısından analizin son dönemi olarak Aralık 2017 tarihi belirlenmiştir. Buna göre aylık frekansta gerçekleştirilen analiz için çalışma dönemi Ocak 2003–Aralık 2017 olarak belirlenmiş olup diğer dönemler analizlere dâhil edilememiştir.

Zaman serisi analizlerinde ilk analiz genellikle serilerin durağanlığının incelenmesidir. Bir zaman serisinin durağan olması, sabit bir ortalama, sabit bir varyans ve gecikme mesafesine bağlı kovaryansa sahip olması durumudur. Nelson ve Plosser (1982) çalışması çoğu zaman serisinin durağan olmadığını ortaya koymaktadır. Zaman serisi kullanarak oluşturulan regresyonda durağan olmayan serilerin kullanılması, yapılan tahminde sahte regresyonu ortaya çıkarabilir (Kutlar, 2000:252). Dickey ve Fuller (1981) çalışması ve sonrasında gerçekleştirilen Phillips ve Perron (1988) çalışmasıyla zaman serilerinin durağanlığını test edebilen metodolojiler geliştirilmiştir. Fuller (1976), Dickey ve Fuller (1979) ve Dickey ve Fuller (1981) çalışması ile önerilen Genişletilmiş Dickey Fuller (ADF) testi otoregresif süreçler ile sabit terimsiz, sabit terimli, trendli ve sabit terimli ekonometrik kalıplar için birim kökün varlığını incelemektedir.

ADF testi ile serinin birim kök içerdiği (durağan olmadığı) boş hipotezinin, birim kök içermediği (durağan olduğu) alternatif hipotezine göre sınaması gerçekleştirilir. Genişletilmiş Dickey Fuller testi sınamaya kalıplarına gecikmeli değerler ekleyerek Dickey Fuller testini otokorelasyon problemine karşı düzeltmiştir. Phillips-Perron birim kök testi ise hata teriminin zayıf derecede bağımlı olmasına ve heterojen olarak dağılmasına izin vermektedir (Enders, 2004:229). Bundan dolayı her iki testin birbirini tamamlar nitelikte olduğu söylenebilir.

Bağımlı ve bağımsız değişkenlerin aynı anda birim kök içermesi ve aynı dereceden fark alınarak ilgili serilerden birim kökün giderilmesi eşbütünleşmenin incelenmesini gerektirir. Değişkenlerin eşbütünleşik olması uzun dönemli bir ilişkinin varlığını ortaya koymaktadır. Diğer bir ifade ile durağan olmayan zaman serilerinin doğrusal bileşimi durağan olabilmektedir. Eşbütünleşme analizi ile değişkenlere ait seriler durağan olmasalar bile bu serilerin durağan bir kombinasyonunun var olabileceği ve varsa bunun belirlenebileceği ifade edilmektedir (Tarı, 2010: 415).

Buna göre eşbütünleşik serilerin uzun dönemde birlikte hareket ettiği söylenebilir. Zaman serileri arasındaki eşbütünleşme ilişkisini belirlemek için Engle ve Granger (1987), Johansen (1988), Johansen ve Juselius (1990) çalışmalarıyla geliştirilen çeşitli yöntemler bulunmaktadır. Johansen (1988) çalışması eşbütünleşme ilişkisinin tespit edilmesi için en çok olabilirlik tahmini ile eşbütünleşme vektörlerinin varlığını araştırılmaktadır. İlgili yöntemde iz testi ve maksimum öz değer testi olmak üzere iki farklı testten yararlanılmakta ve hesaplanan istatistiklerin kritik değerlerle karşılaştırılması yapılarak eşbütünleşme ilişkisinin bulunup bulunmadığına karar verilmektedir. Eşbütünleşme ilişkisinin varlığı altında Granger (1987) çalışması seriler arasında bir nedensellik ilişkisinin bulunmadığının incelenmesi için hata düzeltme modelini önermektedir. ECT eşbütünleşme ilişkisinden oluşan kalıntıları ifade etmek üzere hata düzeltme modeli aşağıdaki gibi ifade edilebilir.

$$\Delta X_t = \alpha_1 + \sum_{i=1}^m \beta_{1i} \Delta Y_{t-1} + \sum_{i=1}^n \gamma_{1i} \Delta X_{t-i} + \sum_{i=1}^r \delta_{1i} ECT_{r,t-1} + u_t \quad (2)$$

$$\Delta Y_t = \alpha_1 + \sum_{i=1}^m \beta_{1i} \Delta X_{t-1} + \sum_{i=1}^n \gamma_{1i} \Delta Y_{t-i} + \sum_{i=1}^r \delta_{1i} ECT_{r,t-1} + u_t \quad (3)$$

İki yönlü olarak incelenebilen eşbütünleşme ilişkisinde ECT'lerin negatif ve anlamlı olması hata düzeltme modelinin işlediğini göstermektedir (Tarı, 2010:416). Eşbütünleşme ilişkisi iki yönlü olarak ifade edilse de reel efektif döviz kuru ve gelen turist sayıları arasındaki ilişki kuramsal olarak tek yönlüdür. Diğer bir ifadeyle döviz kuru üzerinde etkili olan faktörler çok çeşitli olabilir. Bundan dolayı bu çalışmada hata düzeltme modeli tek yönlü olarak incelenmiş reel efektif döviz kuru endeksinin gelen turist sayıları üzerindeki etkisi ve aynı yöndeki nedensellik incelenmiştir.

4.BULGULAR

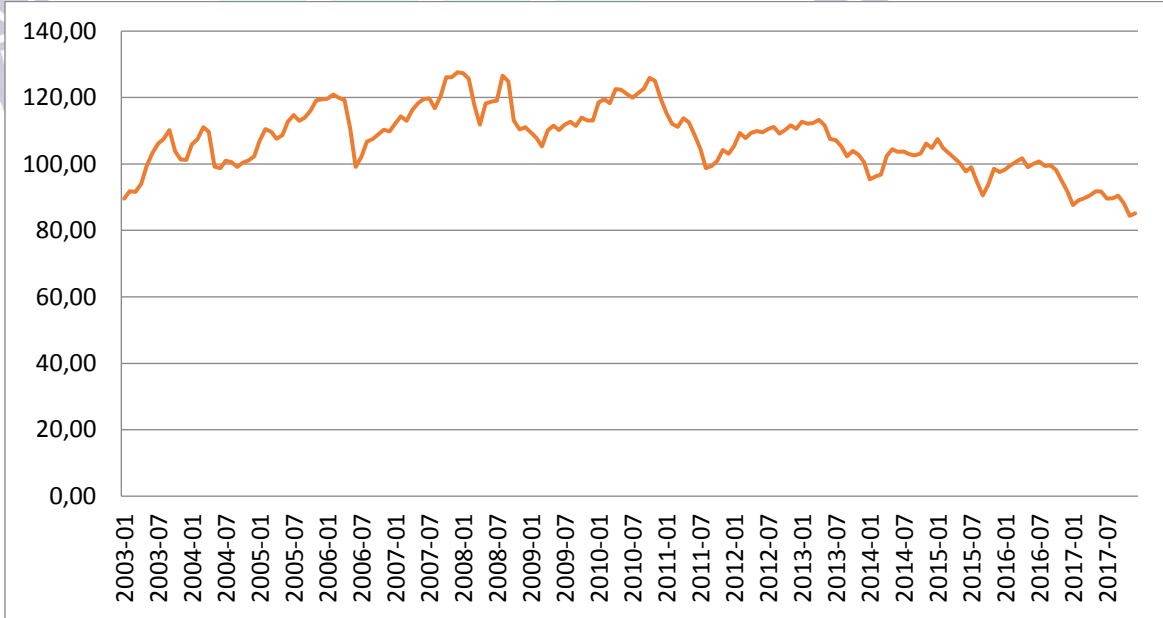
Turizm sektörünün çalışma dönemindeki örnekleme bağlı bir değerlendirmesi için hesaplanan tanımlayıcı istatistikler Tablo 2'de verilmiştir. Tablo 2 değerlendirildiğinde aylık ortalama itibarıyla en çok turistin Avrupa OECD ülkelerinden geldiği görülmektedir. Ortalamada 1.079.376 gelen turist sayısını 499.859 ile Bağımsız Devlet Topluluğu takip etmektedir. En düşük ortalama gelen turist sayısına sahip ülke topluluğu ise Güney Doğu Asya ülke grubuna aittir.

Tablo 2. Turizm Verisine Ait Tanımlayıcı İstatistikler

| | Maksimum | Minimum | Ortalama | Std. Sap. | Gözlem Sayısı |
|--------|-----------|---------|-----------|-----------|--|
| AFRK | 125.010 | 6.949 | 41.188 | 24.392 | 2003 – 2017 15 Yıl * 12 Ay 180 Dönem |
| AMRK | 36.089 | 670 | 12.692 | 8.620 | |
| AVOCD | 2.724.946 | 170.525 | 1.079.376 | 681.937 | |
| BADETO | 1.651.987 | 45.697 | 499.859 | 366.680 | |
| BATAS | 634.336 | 20.643 | 170.345 | 106.909 | |
| DASYA | 47.616 | 1.392 | 13.036 | 9.534 | |
| DAVRU | 412.124 | 78.979 | 209.612 | 71.270 | |
| DOECD | 208.902 | 18.171 | 96.605 | 52.853 | |
| GASYA | 361.756 | 16.775 | 122.428 | 63.913 | |
| GDASYA | 41.744 | 1.045 | 12.421 | 7.718 | |

Analizlerde kullanılan diğer değişken olan reel efektif döviz kurunun Ocak 2003 – Aralık 2017 dönemleri arası gelişimi analitik olarak Grafik 1’de görülebilir. Grafik 1 incelendiğinde ilgili endeks verisinin 2010 yılından sonra düşü eğiliminde olduğu, en yüksek olduğu döneme ise 127,63 ile 2007 yılının 12. ayında ulaştığı söylenebilir. 2017 yılının Aralık ayı itibariyle ilgili seri en düşük düzeyine gerilemiştir. Döviz kuru paritesinden farklı olarak reel efektif döviz kuru endeksinin azalması TL’nin değer kaybettiği şeklinde yorumlanmaktadır.

Grafik 1. Reel Efektif Döviz Kuru Endeksi



Farklı bölgelerden gelen turist sayısı ile reel efektif döviz kuru endeksi arasında kısa ve/veya uzun dönemli bir ilişkinin olup olmadığını incelemek amacıyla ilk olarak analize dâhil edilecek serilerin logaritması alınmıştır. Logaritması alınan serilere ait tanımlayıcı istatistikler Tablo 3’de incelenebilir.

Tablo 3. Analizlerde Kullanılan Değişkenlere Ait Tanımlayıcı İstatistikler

| | Maksimum | Minimum | Ortalama | Std. Sap. |
|--------|----------|---------|----------|-----------|
| AFRK | 5,097 | 3,842 | 4,533 | 0,276 |
| AMRK | 4,557 | 2,826 | 3,977 | 0,370 |
| AVOECD | 6,435 | 5,232 | 5,931 | 0,313 |
| BADETO | 6,218 | 4,660 | 5,583 | 0,326 |
| BATAS | 5,802 | 4,315 | 5,147 | 0,284 |
| DASYA | 4,678 | 3,144 | 4,008 | 0,310 |
| DAVRU | 5,615 | 4,898 | 5,296 | 0,152 |
| DOECD | 5,320 | 4,259 | 4,913 | 0,261 |
| GASYA | 5,558 | 4,225 | 5,020 | 0,261 |
| GDASYA | 4,621 | 3,019 | 3,997 | 0,312 |
| REDK* | 2,106 | 1,926 | 2,029 | 0,040 |

* Reel Efektif Döviz Kuru Endeksi

Analizlerde kullanılan değişkenler düzey ve fark seviyesinde gerçekleştirilen sabitli (*individual intercept*) ile sabitli ve trendli (*individual intercept and trend*) birim kök sınaması sonuçları Tablo 4'de görülebilir.

Tablo 4. Birim Kök Sınaması Sonuçları

| | ADF | | PP | | ADF | | PP | |
|--------|---------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | Düzyen I(0) | | | | Fark I(1) | | | |
| | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend | Sabit | Sabit + Trend |
| AFRK | -1,083 (0,722) | -2,012 (0,590) | -3,280** (0,017) | -7,960* (0,000) | -3,618* (0,006) | -3,640** (0,029) | -19,413* (0,000) | -19,370* (0,000) |
| AMRK | -3,177** (0,023) | -2,153 (0,511) | -4,394* (0,000) | -5,833* (0,000) | -4,499* (0,000) | -5,138* (0,000) | -14,958* (0,000) | -14,948* (0,000) |
| AVOECD | -2,175 (0,216) | -1,795 (0,702) | -5,443* (0,000) | -5,415* (0,000) | -3,056** (0,032) | -3,587** (0,018) | -8,795* (0,000) | -8,780* (0,000) |
| BADETO | -1,106 (0,712) | -2,502 (0,326) | -4,520* (0,000) | -4,191* (0,005) | -4,063* (0,001) | -3,977** (0,011) | -6,991* (0,000) | -6,974* (0,000) |
| BATAS | -1,385 (0,588) | -2,383 (0,387) | -3,822* (0,003) | -5,850* (0,000) | -3,751* (0,004) | -3,743** (0,022) | -12,038* (0,000) | -12,022* (0,000) |
| DASYA | -2,763 (0,065) | -6,702* (0,000) | -2,485 (0,120) | -6,427* (0,000) | -3,709* (0,004) | -3,662** (0,027) | -37,414* (0,000) | -37,268* (0,000) |
| DAVRU | -1,473 (0,579) | 3,454** (0,047) | -4,761* (0,000) | -5,704* (0,000) | -3,419** (0,011) | -3,565** (0,035) | -9,866* (0,000) | -9,847* (0,000) |
| DOECD | -2,139 (0,229) | -0,408 (0,986) | -4,204* (0,000) | -4,162* (0,006) | -3,867* (0,002) | 5,161* (0,000) | -9,323* (0,000) | -9,598* (0,000) |
| GASYA | -1,617 (0,471) | -2,473 (0,340) | -5,419* (0,000) | -7,729* (0,000) | -4,712* (0,000) | -4,715* (0,000) | -23,401* (0,000) | -23,362* (0,000) |
| GDASYA | -1,397 (0,582) | -1,857 (0,671) | -4,164* (0,001) | -7,816* (0,000) | -5,169* (0,000) | -5,184* (0,000) | -24,770* (0,000) | -25,535* (0,000) |
| REDK | -1,939 (0,313) | -3,118 (0,105) | -2,095 (0,246) | -3,005 (0,133) | -10,134* (0,000) | -10,340* (0,000) | -10,017* (0,000) | -10,138* (0,000) |

Parantez içerisindeki değerler olasılık değerleridir. * ve ** sırasıyla %1 ve %5 seviyesinde anlamlılığı göstermektedir. ADF istatistiğinin hesaplanmasında kullanılan gecikme için Schwartz Bilgi Kriterinden yararlanılmıştır. PP istatistiğinin hesaplanmasında kullanılan gecikme için Newey-West bant genişliği seçilmiştir.

Tablo 4 sonuçları tüm seriler için düzeyde birim kökün varlığını ortaya koymaktadır. Ayrıca fark seviyesinde ise birim kökün varlığına ilişkin bulgulara ulaşılamamıştır. Bu durumda tüm seriler 1. dereceden bütünleşiktir I(1). Bu bulgu ülke gruplarına göre giriş yapan turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasında eşbütünleşme ilişkisi olabileceğini ortaya koymaktadır.

Eşbütünleşme ilişkisinin varlığını sınamak için Johansen (1988) çalışması ile geliştirilen eşbütünleşme sınaması gerçekleştirilmiştir. Eşbütünleşme ilişkisi lineer deterministik trend ile sabitin var olduğu ve olmadığı modeller için uygun gecikme seviyesinde ayrı ayrı sınanmıştır. Elde edilen sonuçlar Tablo 5'de verilmiş olup eşbütünleşme modelleri ile optimal gecikme uzunlukları kullanılan değişkenlere göre farklılık gösterebilmektedir.

Tablo 5. Johansen Eşbütünleşme Sınaması Sonuçları

| Değişkenler | Hipotez | Test Değerleri | | Kritik Değerler %5 | |
|---------------|---------|----------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | | λ_{iz} | λ_{max} Öz | λ_{iz} | λ_{max} Öz |
| AFRK - REDK | r = 0 | 16,776** | 15,370** | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 1 | 1,406 | 1,406 | 3,841 | 3,841 |
| AMRK - REDK | r = 0 | 36,139* | 32,022* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 4,117 | 4,117 | 9,164 | 9,164 |
| AVOCD - REDK | r = 0 | 166,510* | 154,175* | 25,872 | 19,387 |
| | r ≤ 1 | 12,335 | 12,335 | 12,518 | 12,518 |
| BADETO - REDK | r = 0 | 36,718* | 36,619* | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 1 | 2,098 | 2,898 | 3,841 | 3,841 |
| BATAS - REDK | r = 0 | 26,753* | 22,210* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 4,542 | 4,542 | 9,164 | 9,164 |
| DASYA - REDK | r = 0 | 16,628** | 14,379** | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 1 | 2,249 | 2,249 | 3,841 | 3,841 |
| DAVRU - REDK | r = 0 | 65,907* | 61,354* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 4,553 | 4,553 | 9,164 | 9,164 |
| DOECD - REDK | r = 0 | 40,812* | 36,834* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 3,977 | 3,977 | 9,164 | 9,164 |
| GASYA - REDK | r = 0 | 30,344* | 25,394* | 20,261 | 15,892 |
| | r ≤ 1 | 4,949 | 4,949 | 9,164 | 9,164 |
| GDASYA - REDK | r = 0 | 21,960* | 19,699* | 15,494 | 14,264 |
| | r ≤ 1 | 2,261 | 2,261 | 3,841 | 3,841 |

* ve ** sırasıyla %1 ve %5 seviyesinde anlamlılığı göstermektedir. Gecikme uzunluğu olarak Schwartz Bilgi Kriterinden yararlanılmıştır.

Tablo 5 sonuçları farklı ülkelere ait gelen turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasında eşbütünleşmenin varlığını ortaya koymaktadır. Buna göre ilgili seriler arasında uzun dönemli bir ilişkinin varlığından söz edilebilir. Elde edilen sonuçlar karşılıklı olarak en az bir eşbütünleşik vektörün olduğunu göstermektedir. Eşbütünleşme ilişkisinin varlığından hareketle reel efektif döviz kurundan Gelen Turist (GT) sayılarına yönelik tek yönlü incelenen hata düzeltme modeli sonuçları Tablo 6'da görülebilir. Hata düzeltme modeline ilişkin sonuçların içeriği değişkenlere ve kullanılan gecikmeye göre farklılaşabilmektedir.

Çünkü optimal eşbütünleşme ilişkisinin varlığı lineer deterministik trend ile sabitin var olduğu veya olmadığı farklı gecikmelere sahip modeller için rapor edilmiştir. Bununla birlikte, hata düzeltme

modelinin işleyebilmesi için hata terimi ECT katsayısının -1 ile 0 arasında olması ve anlamlı olması gerekmektedir. Bu durum kısa dönemde oluşan dengeden sapmaların uzun dönemde ortadan kalktığını da göstermektedir. Tablo 6 bu açıdan incelendiğinde tüm modeller için hata düzeltme modelinin işlediğini sadece reel efektif döviz kuru endeksi ile Doğu Asya ülkelerinden gelen turist sayıları arasındaki hata düzeltme modelinin işlemediğini ortaya koymaktadır. Hata düzeltme modeli kısa ve uzun dönemli nedensellik ilişkilerinin birbirinden ayrılması avantajını sağlamaktadır. Bağımsız değişkenlerdeki gecikme değerleri, kısa dönemli nedensel etkileri, hata düzeltme terimi ise, uzun dönemli nedensel etkileri temsil etmektedir (Love ve Chandra, 2005; 136).

Tablo 6. Hata Düzeltme Modeli Sonuçları

| | C | Δ GT (t-1) | Δ RE DK (t-1) | Δ GT (t-2) | Δ RE DK (t-2) | Δ GT (t-3) | Δ RE DK (t-3) | ECT | DW | F |
|-----------------|---------------------------|------------------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------------------|-------|-------------------|
| REDK →AFRK | 0,006 (0,460) | -0,324* (0,000) | 0,354 (0,63 6) | | | | | - 0,08* * (0,01 1) | 2,149 | 11,268 (0,000) |
| REDK →AMRK | | 0,028 (0,692) | 0,583 (0,61 3) | 0,269 * (0,000) | -0,782 (0,50 0) | | | - 0,208 * (0,00 0) | 2,067 | 9,132 (0,000) |
| REDK →AVOEC | - 0,002 (0,81 2) | 0,379* (0,000) | - 0,578 (0,42 8) | - 0,775 (0,29 1) | 0,633 * (0,00 0) | | | - 0,465 * (0,00 0) | 2,55 | 56,947 (0,000) |
| REDK →BADETO | | 0,708* (0,000) | 0,922 (0,17 2) | - 0,055 (0,49 8) | 1,794 * (0,01 0) | 0,227 * (0,00 1) | 1,052 (0,12 6) | - 0,263 * (0,00 0) | 1,876 | 32,580 (0,000) |
| REDK →BATAS | | 0,147* * (0,044) | 0,180 (0,80 5) | | | | | - 0,123 * (0,00 0) | 2,034 | 8,222 (0,000) |
| REDK →DASYA | 0,007 (0,34 8) | -0,227* (0,002) | 0,220 (0,73 0) | | | | | -0,027 (0,24 4) | 1,879 | 4,223 (0,000) |
| REDK →DAVRU | | 0,335* (0,000) | - 0,053 (0,89 9) | 0,382 * (0,00 0) | - 0,226 (0,59 7) | | | - 0,334 * (0,00 0) | 2,099 | 25,741 (0,000) |
| REDK →DOECD | | 0,516* (0,000) | 0,669 (0,31 4) | | | | | - 0,213 * (0,00 0) | 2,015 | 45,178 (0,000) |

| | | | | | | | | | | |
|-----------------|----------------------|-----------------------------|----------------------|--|--|--|--|--------------------------------|-------|-------------------|
| REDK →GASYA | | - 0,166* *(0,023) | 0,259 (0,80 4) | | | | | - 0,239 *(0,00 0) | 2,051 | 18,567 (0,000) |
| REDK →GDASYA | 0,008 (0,38 0) | -0,068 (0,356) | 1,242 (0,12 9) | | | | | - 0,090 *(0,00 3) | 2,017 | 4,475 (0,004) |

Parantez içerisindeki değerler olasılık değerleri olup * ve ** sırasıyla %1 ve %5 seviyesinde anlamlılığı göstermektedir. Gecikme uzunluğu olarak Schwartz Bilgi Kriteri'nden yararlanılmıştır.

Nedensellik ilişkisini değerlendirmek amacıyla ECT katsayıları incelendiğinde uzun dönemde reel efektif döviz kurunun Doğu Asya ülke grubu hariç tüm diğer ülke gruplarından gelen turist sayılarına neden olduğu söylenebilir. Uzun dönemde tespit edilen nedensellik ilişkisinin yönü normalleştirilmiş eşbütünleşme katsayılarından görülebilir.

Tablo 7. Kısa ve Uzun Dönem Nedensellik İlişkisi

| | Uzun Dönem | Kısa Dönem |
|--------------|-------------------|---------------------------|
| | REDK Katsayısı | Bütünleşik Wald (F) testi |
| REDK →AFRK | -5,670 [3,17] | 0,223 (0,636) |
| REDK →AMRK | -1,642 [1,122] | 0,289 (0,748) |
| REDK →AVOEC | -0,627 [4,459] | 1,153 (0,318) |
| REDK →BADETO | -1,562 [1,708] | 2,520 (0,059) |
| REDK →BATAS | -3,754 [2,486] | 0,060 (0,805) |
| REDK →DASYA | -7,853 [3,505] | 0,119 (0,730) |
| REDK →DAVRU | -0,961 [2,777] | 0,175 (0,839) |
| REDK →DOECD | -1,220 [1,300] | 1,019 (0,314) |
| REDK →GASYA | -2,515 [2,024] | 0,0613 (0,804) |
| REDK →GDASYA | -6,026 [3,173] | 2,322 (0,129) |

Köşeli parantez içerisindeki değerler t istatistikleridir. Parantez içerisindeki değerler olasılık değerleridir.

Kısa dönemdeki nedensellik ilişkisi ise modellerde yer alan $REDK_{t-1}$ ve varsa diğer gecikmeli $REDK_{t-n}$ katsayılarının Wald testi yardımıyla bütünleşik olarak sıfırdan farklı olup olmadığının sınanması neticesinde incelenebilir. Tablo 7'de tespit edilen uzun dönemli nedensellik ilişkisinin yönünü görmek üzere normalleştirilmiş eşbütünleşme katsayıları ile kısa dönem için hata düzeltme modeline bağlı bütünleşik Granger nedensellik analizi sonuçlarına yer verilmiştir.

Tablo 7 incelendiğine reel efektif döviz kuru endeksinin eşbütünleşme vektöründe yer alan normalleştirilmiş katsayı işaretçilerin negatif olduğu görülmektedir. Buna göre uzun dönemde reel efektif döviz kurundan gelen turist sayısına doğru olan nedensel ilişkinin negatif yönlü olduğu söylenebilir. Diğer bir ifadeyle uzun dönemde reel efektif döviz kurundaki azalışlar (TL'nin değer kaybetmesi) gelen turist sayılarını anlamlı olarak arttırmaktadır. Benzer şekilde reel efektif döviz kurundaki artışlar (TL'nin değer kazanması) gelen turist sayısını azaltmaktadır. Bu konuda anlamlı etkilerin olmadığı tek ülke grubu Doğu Asya ülke grubudur. Kısa dönemli nedenselliğin incelendiği bütünleşik Wald testi sonuçları ise hata düzeltme modeline bağlı Granger nedensellik analizi olarak ifade edilmekte ve “nedensellik yoktur” boş hipotezinin tüm ülke gruplarında reddedilemeyeceğini ortaya koymaktadır. Diğer bir ifade ile kısa dönemde, reel efektif döviz kuru ile ülke gruplarından gelen turist sayıları arasında nedensellik söz konusu değildir. Bu bulguya aynı zamanda Tablo 6'da yer alan REDK_{t-1} ve varsa diğer gecikmeli REDK katsayılarının anlamlılığı incelenerek ulaşılabilir.

5.SONUÇ

Bu çalışmada reel efektif döviz kurunun farklı ülke gruplarından gelen turist sayıları üzerinde kısa ve uzun dönemde etkisi olup olmadığını incelenmiştir. Bu bağlamda aylık frekanstaki verilerden yararlanılarak her ülke grubu için reel efektif döviz kuru ile gelen turist sayıları arasında ayrı ayrı eşbütünleşme ve hata düzeltme modeli uygulanmıştır. Aylık frekanstaki veriler üzerine gerçekleştirilen analizler Ocak 2003–Aralık 2017 dönemini kapsamaktadır. Analizlerden elde edilen sonuçlar uzun dönemde Doğu Asya ülke grubu hariç diğer tüm ülke gruplarından gelen turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasında negatif yönlü nedensellik ilişkisi olduğunu ortaya koymaktadır. Buna göre döviz kurundaki artışlar gelen turist sayılarını uzun dönemde azaltırken bu durumun tam tersi de geçerlidir. Kısa dönemli nedensellik ilişkisinin sonuçları ise döviz kuru ile gelen turist sayıları arasında anlamlı bir nedensellik ilişkisi olmadığını ortaya koymaktadır. Diğer bir ifade ile kısa dönemde döviz kuru değişimlerinin gelen turist sayıları üzerinde bir etkisi tespit edilememiştir. Bu çalışmada elde edilen bir sonuç olan uzun dönemli nedenselliğin kısa dönemde olmaması durumu Tang (2013) çalışmasında da tespit edilen bir sonuçtur. Ayrıca uzun dönemde tespit edilen gelen turist sayıları ile reel efektif döviz kuru arasındaki negatif yönlü nedensellik ilişkisi Bahar (2007), Kuo ve diğ. (2010), Agiomirgianakis ve diğ. (2014) çalışmalarında da tespit edilmiştir.

Çalışma sonuçlarından birisi olan Doğu Asya ülke grubundan Türkiye'ye gelen turist sayısı ile reel efektif döviz kuru arasında anlamlı bir nedensellik bulunamamasının çeşitli sebepleri olabilir. Benzer bulgulara ulaşan Kiang ve diğ. (2015) çalışmasında Turizm'in önceden planlanan ve satın alınan bir faaliyet olduğu ifade edilmektedir. Buna göre Doğu Asya ülke grubundan Türkiye'ye gelen turist sayısı arasında nedensellik olmaması bu argüman ile açıklanabilir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Çalışmadan elde edilen sonuçlar politika yapıcılar açısından değerlendirildiğinde döviz kurundaki olumsuz hareketlerin uzun dönemde gelen turist sayılarını etkileyeceğini dolayısıyla döviz kurundaki hareketliliğin düşük olduğu dönemlerde uzun dönemli planlamalar yapılarak gelen turist sayılarının korunabileceğini söylemek mümkündür. Turizm acentelerinin bu konuda yapabilecekleri ve bunun etkileri ise yeni çalışmaların konusunu oluşturacaktır.

KAYNAKÇA

- Agiomirgianakis, G., Serenis, D., & Tsounis, N. (2014). Exchange Rate Volatility and Tourist Flows into Turkey. *Journal of Economic Integration*, 700-725.
- Agiomirgianakis, G., Serenis, D., & Tsounis, N. (2015). The Effects of Exchange Rate Volatility on Tourist Flows: Evidence from the UK and Sweden. *International Journal of Tourism Policy*, 6(1), 1-16.
- Bahar, O. (2007). Türkiye'deki Devalüasyon Uygulamalarının Turizm Sektörü Üzerindeki Etkisi. *Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 12(1), 255-272.
- Belloumi, M. (2010). The Relationship between Tourism Receipts, Real Effective Exchange Rate and Economic Growth in Tunisia. *International Journal of Tourism Research*, 12(5), 550-560.
- Bozkurt, K., & Pekmezci, A. (2015). Turizm Talebi ve Döviz Kuru Şokları: Türk Turizm Sektörü İçin Ekonometrik Bir Analiz. *Eskişehir Osmangazi Üniversitesi İİBF Dergisi*, 10(2), 91-105.
- Chiu, Y.B., Yeh, L.T., (2017). The Threshold Effects of the Tourism-Led Growth Hypothesis: Evidence from a Cross-Sectional Model. *Journal of Travel Research*, 56(5), pp. 625-637.
- Crouch, G.I., (1993). Currency Exchange Rate and the Demand for International Tourism. *Journal of Tourism Studies*, 4(2), pp. 45-53.
- Crouch, G. I. (1994). The Study of International Tourism Demand: A Review of Findings. *Journal of Travel Research*, 33(1), 12-23.
- Demirel, B., Bozdağ, E. G., & İnci, A. G. (2008). Döviz Kurlarındaki Dalgalanmaların Gelen Turist Sayısına Etkisi: Türkiye Örneği. DEÜ Ulusal İktisat Kongresi, İzmir, http://www.deu.edu.tr/userweb/iibf_kongre/dosyalar/demirel.pdf (Erişim Tarihi: 30 Ağustos 2018).
- Dickey, D. A., & Fuller, W. A. (1979). Distribution of the Estimators for Autoregressive Time-Series with a Unit Root. *Journal of the American Statistical Association*, 74(366a), 427-431.
- Dickey, D. A., & Fuller, W. A. (1981). Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time-Series with a Unit Root. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, 1057-1072.
- Enders, W. (2008). *Applied econometric time series*. John Wiley & Sons.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Engle, R. F., & Granger, C. W. (1987). Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, 251-276.
- Farver, J. A. M. (1984). Tourism and Employment in the Gambia. *Annals of Tourism Research*, 11(2), 249-265.
- Fuller, W. A. (2009). *Introduction to Statistical Time Series* (Vol. 428). John Wiley & Sons.
- Göymen, K. (2000). Tourism and Governance in Turkey. *Annals of Tourism Research*, 27(4), 1025-1048.
- Henderson, J. O. A. N. (2001). Tourism and the Arts: A View from Singapore. *Tourism Culture & Communication*, 3(1), 27-36.
- Johansen, S. (1988). Statistical Analysis of Cointegration Vectors. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 12(2-3), 231-254.
- Johansen, S., & Juselius, K. (1990). Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration— with Applications to the Demand for Money. *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 52(2), 169-210.
- Kiang, Y. J., Sarochananjeen, O., Yang, F. J., & Wang, Y. H. (2015). Relationship between Exchange Rates and Tourist Number in Thailand: Empirical Analysis of Panel Data. *Journal of Accounting, Finance & Management Strategy*, 10(2), 107.
- Kuo, H. I., Wang, H. C., Hwang, W. Y., & Ye, C. Y. (2009). Tourism demand and exchange rates in Asian countries: Evidence from a panel data approach. In *Computer Science and Information Engineering, 2009 WRI World Congress on* (Vol. 4, pp. 508-512). IEEE.
- Kutlar, A. (2000). *Ekonometrik Zaman Serileri*. Gazi Kitabevi.
- Leiper N., (2008). Why 'the Tourism Industry' is Misleading as a Generic Expression: The Case for the Plural Variation, 'Tourism Industries'. *Tourism Management*, 29(2), pp. 237-251.
- Nelson, C. R., & Plosser, C. R. (1982). Trends and Random Walks in Macroeconomic Time-Series: Some Evidence and Implications. *Journal of Monetary Economics*, 10(2), 139-162.
- Paramati, S.R., Alam, M.S. and Chen, C.F., (2017). The Effects of Tourism on Economic Growth and CO2 Emissions: A Comparison between Developed and Developing Economies. *Journal of Travel Research*, 56(6), pp. 712-724.
- Phillips, P. C. B. (1988). Testing for a Unit Root in Time-Series Regression. *Biomètrika*, 75(2), 335-46.
- Quadri, D. and Zheng, T., (2010). A Revisit to the Impact of Exchange Rates on Tourism Demand: The Case of Italy. *Journal of Hospitality Financial Management*, 18(2), pp. 47-60.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Samırkaş, M., & Samırkaş, M. C. (2015). The Impact of Exchange Rate on Tourism Industry: The Case of Turkey. In Handbook of Research on Global Hospitality and Tourism Management (pp. 107-118). IGI Global.
- Sinclair, M. T. (1998). Tourism and Economic Development: A Survey. The Journal of Development Studies, 34(5), 1-51.
- Stettler, C. (2017). How Do Overnight Stays React to Exchange Rate Changes?. Swiss Journal of Economics and Statistics, 153(2), 123-165.
- Tang, C. F. (2013). Temporal Granger Causality and the Dynamics Relationship between Real Tourism Receipts, Real Income and Real Exchange Rates in Malaysia. International Journal of Tourism Research, 15(3), 272-284.
- Tarı, R. (2010). Ekonometri (6. Baskı). Kocaeli: Umuttepe Yayınları.
- Vanegas Sr, M., & Croes, R. R. (2000). Evaluation of Demand: US Tourists to Aruba. Annals of Tourism Research, 27(4), 946-963.
- De Vita, G. and Kyaw, K.S., (2013). Role of the Exchange Rate in Tourism Demand. Annals of Tourism Research, 43, pp. 624-627.
- Wang, L., & Tang, X. (2018) ‘‘Does RMB Exchange Rate Volatility Affect Beijing’s Inbound Tourism Development?’’. In 2018 4th International Conference on Information Management (ICIM)(pp. 206-209). IEEE.
- Webber, A. G. (2001) ‘‘Exchange Rate Volatility and Cointegration in Tourism Demand’’, Journal of Travel Research, 39(4): 398-405.

**İZMİR İLİ BELEDİYELERİ TARAFINDAN DÜZENLENEN FESTİVALLERE YÖNELİK
BİR İNCELEME**

Doç.Dr. Burcu ÖKSÜZ*

Yeliz Yapıcıoğlu AYAZ**

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, İzmir iline bağlı olan belediyeler tarafından düzenlenen çeşitli hedef kitlelere hitap eden, farklı amaçlarla planlanan ve değişik içeriklere sahip olan festivalleri belirlenen kategoriler çerçevesinde incelemektir. Festivaller, belediyeler tarafından yerel ve uluslararası düzeyde organize edilmekte ve bölgenin tanıtımına katkı sağlayabilmektedirler. Çalışmada, 'Festival başlangıç yılları', 'Konuları', 'Amaçları', 'Tarihleri', 'Türleri', 'Hedef kitle' 'Düzenlenen mevsimler', 'Festival programı içerikler', 'Festivaldeki etkinlikler', 'Festivalde yer alan bireyler' olmak üzere belirlenen 10 kategori çerçevesinde analiz yapılmıştır. Farklı belediyeler tarafından düzenlenen festivallerin düzenli şekilde yapılmış olmaları temel alınmış ve festival bilgilerine belediye sayfalarından erişim sağlanmıştır. Çalışmada yer verilmiş olan çeşitli kapsamdaki 48 festivalin birbirleriyle benzerlikleri ve farklı yönleri üzerinde değerlendirme yapılmıştır.

Anahtar kelimeler: *İzmir, Belediye, Festival, İletişim, Durum Analizi*

ABSTRACT

The aim of this study is to examine festivals, which address to different kinds of target groups, planned with different purposes and have different contents, organized by municipalities in the province of İzmir according to identified categories. Festivals are organized by municipalities within the frame of local and international level and provide to contribute region publicity. There will be made comparative analysis via identified 10 categories. In this study, these categories are 'Starting year of festivals', 'Contents', 'Purposes', 'Dates', 'Types', 'Target Group', 'Edited Season', 'Content of festival programme', 'Festival activities', 'Individuals in festivals'. Festivals which organized by different municipalities base upon regularity and content of festivals were reached through web pages of municipalities. 48 festivals are assessed with their dissimilar and similar characteristics. This study is targeted to make contribution future studies about this issue.

Key words: *İzmir, Municipalities, Festivals, Communication, Situational Analysis*

* İzmir Kâtip Çelebi Üniversitesi, Medya ve İletişim Bölümü, Halkla İlişkiler ve Reklamcılık Anabilim Dalı, İzmir, burcu.oksuz@ikc.edu.tr

** Ege Üniversitesi İletişim Fakültesi, Genel Reklamcılık Anabilimdalı, İzmir, yeliz.yapicioglu@gmail.com

1. GİRİŞ

Tarihsel süreç içinde özel etkinlikler, grubun birlikte çalışmasıyla müşterek amaçları yerine getirmek, toplanmak, sosyalleşmek gibi ihtiyaçlarını karşılamak ve imkanlarını sıralamak adına yaygın şekilde kullanılmıştır (Kargiglioğlu ve Kabacık, 2017: 410). Tüm kültürlerdeki insanlar, yüzyıllar öncesinden beri belirli zamanlarını toplumsal kutlamalara ayırmış ve bunu bir gereklilik olarak benimsemişlerdir (Sert, 2017: 31). Genel olarak sosyal ve kültürel kutlamalar olarak görülen festivaller (Frsiby ve Getz, 1989: 7), sosyal ve kültürel roller nedeniyle evrensel bağlamda önemli görülmekte ve giderek artan şekilde bir turizm çekiciliği olarak yaratılmakta ve teşvik edilmektedir (Andersson ve Getz, 2008: 200).

Festivaller yerel düzeyde sahip olunan değerlerin, doğal zenginliklerin, geleneklerin, kültürel çeşitliliğin, tarihsel dokunun, farklılıklardan gelen hoşgörünün yerel sınırları aşarak ulusal ve uluslar arası bağlamda ziyaretçilerle buluştuğu etkinliklerdir. Kültürel zenginliğin ve çeşitliliğin derinden hissedilmesi ve yaşanmasını sağlayan bir atmosfer yaratan festivaller; birbirini anlamaya, paylaşmaya ve geçmişten gelen bağları kuvvetlendirmeye katkı sağlamaktadırlar. Bunun yanı sıra, insanlar arasındaki iletişimi güçlendirmekte ve festivalleri düzenleyen belediyeler ile kitleler arasında bir sempati yaratmaktadır.

Festivaller, belediyelerin markalama çalışmalarının bir parçası haline gelmekte ve uzun dönemde güçlü bir imaj yaratma fırsatı vermektedir. Bu bağlamda, sahip olunan kültürel değerlerin anlatılması açısından bir köprü görevi görmektedir. Başarılı şekilde organize edilmiş ve amaçlarına ulaşmış festivaller, belediyelerin farklılaşmasına aracılık ederek hem ulusal hem de uluslararası düzeyde bilinirliğini arttırmaktadır. Bu çalışmanın amacı, İzmir ili belediyeleri tarafından 2017 yılında organize edilen festivalleri inceleyerek genel durumu ortaya koymaktır.

2. GENEL OLARAK FESTİVAL

Festival, “Antik çağlardan günümüze süregelen, toplumların kendileri için önemli gördükleri olayların, olguların zaman ve mekânla sınırlı olarak kutlanması” olarak tanımlanmıştır (Sert, 2017: 32). Bilgili ve diğerleri (2012: 118) festivali “Dönemi, yapıldığı çevre, konusu, katılanların sayısı gibi nitelikleri belli bir programla belirtilen ve özel önemi olan sanat, kültür, bilim, ekonomik faaliyet, ürün, dönem veya belli bir temaya yönelik olarak düzenlenen, tek seferlik veya belli aralıklarla tekrarlanan gösteri ve etkinlikler dizisi” olarak tanımlamaktadır. Şengül ve Genç (2016: 80) ise “İçerikleri, amaçları, zamanları, mekânları, organizasyon şekilleri vb. unsurların farklılıklarından dolayı festival kavramı üzerine tam bir tanım verilemediğini” belirtmekte ve festivalleri “Çeşitli nedenlerle belirli periyotlarda gerçekleştirilen toplumsal kutlamalar” olarak ifade etmektedir.

Festivaller “Bireyler ve toplumlar arasında ekonomik, sanatsal, kültürel ve sosyal açıdan bir yakınlaşmayı” amaçlar (Dalgın vd., 2016: 1180). Ziyaretçilere daha önce görülmeyen yerleri görme, kültürleri tanıma, farklı yaşam biçimlerine sahip insanlarla bir arada bulunma gibi pek çok fırsat sunan festivaller (Gül vd., 2013: 214), dünyadaki insanların dostluklarının pekişmesine katkı sağlamakta, yeni kültürleri ve yaşamları tanımaya olan merakı arttırmakta (Çulha, 2008: 1833), yerel olan ve olmayan kişilerin yerel değerler bağlamında iletişim kurmasını ve yerel alanın dışarının ilgisini çekmesini aracılık etmektedir (Gül vd., 2013: 216). Bunların yanı sıra kültürel mirasın oluşumu ve gelecek kuşaklara aktarılması açısından da festivaller önemli bir rol üstlenmektedir (Atak vd., 2017: 1397). Bu bağlamda Uzunkaya (2009: 2) “Festivallerin gerek ulusal gerekse uluslar arası alanda, insanları din, dil, ırk farklılıklarını gözetmeksizin biraraya getirme özelliği” bulunduğu vurgu yapmaktadır.

Festivaller, şehrin veya bölgenin ruhunu yansıtmakta, bu etkinliklerle anımları sayesinde benzer diğer yerlerden ayrılmasına (Dalgın vd., 2016: 1180), ülkenin ve kültürel değerlerin tanıtımına katkı sunarlar (Penpece, 2014: 194). Özkan ve diğerleri (2015: 60) kısa bir süreyi içermesi, yoğunluğunun fazla olması, senede bir kez düzenlenmesi, kamuya açık olması gibi faktörlerden ötürü festivallerin tanıtım ve imaj açısından önemli roller üstlendiklerini vurgulamaktadır. Bu bağlamda festivaller yer pazarlaması ve destinasyon imajı yaratımı araçları olarak görülebilmekte ve şehirlerin, tatil yerlerini ve turistik yerleri canlandırma yeteneğine sahip olduğu kabul görmektedir (Andersson ve Getz, 2008: 200). Marka değerini arttıran etkinlikler olduğu kabul edilen festivallerin (Özkan vd., 2015: 60); düzenledikleri bölgelere turizm sezonunun uzaması, turizmin çeşitlenmesi, turizm talebinin eşit dağılımı gibi pek çok faydası bulunmaktadır (Tayfun ve Arslan, 2013: 192). Bu anlamda, festivaller turizmin gelişimi açısından da yadsınamayacak bir öneme sahiptirler.

Festival düzenleyenler, kısa sürede ve belirli bir alanda ziyaretçilerin memnuniyetleri sağlayacak hizmetler sunmayı amaçlarlar (Doğrul vd., 2015: 73). Bundan dolayı, festivallerin gelişigüzel ve hazırlıksız düzenlenmesi yerine stratejik amaçlar doğrultusunda planlı şekilde organize edilmesi, hem festivalin başarısını arttıracak hem de kitlelerle olan iletişim bağını kuvvetlendirecektir. Aksi halde festivalden memnuniyetsiz olarak ayrılan kitlelerin fikirlerini diğerleri ile paylaşması kaçınılmaz olacaktır.

Festivallerin organizasyon planlarından en sondaki faaliyete kadar her aşamada amaç ve fikir birliği ile hareket edilmesi gerekir (Şengül ve Genç, 2016: 81). Festivalin paydaşı olan her kişi ve grubun hazırlık ve uygulama süreçlerinin her basamağında aktif olarak rol alması, festivalin verimliliği açısından temel bir gereklilik olarak görülmelidir. Bu süreçte belediyelerin yerel halkın desteğini alması başarının bir anahtarı olarak değerlendirilmelidir. Şöyle ki, Yıldız ve Polat'ın (2016:41) ifade ettiği gibi “yerel halkın katılımının sağlanması, festivallerin başarısı ve sürdürülebilirliği açısından oldukça önemlidir.”

Gül ve diğerleri (2013: 215) program içeriğinin ve faaliyetlerin önceden planlanmasının festival başarısını belirlediğini vurgulamaktadır. Bundan dolayı, festival düzenleyen kurum ve belediyelerin uzun bir zaman önce festivalleri stratejik planlarına dahil etmeleri olası problemlere karşı önceden hazırlık olmaları gerekmektedir. Her yıl düzenli olarak organize edilen festivaller belediyeler açısından da büyük bir deneyim fırsatı yaratacak ve kitlelerle olan ilişkilerin temelini oluşturacaktır.

İlgili yazında festivallere yönelik yapılan çeşitli çalışmalar bulunmaktadır. Erdem ve diğerleri (2018) tarafından yapılan Uluslararası Mengen Aşçılık ve Turizm Festivali örneğinde festivallerin katkılarının araştırıldığı çalışmada, festivalleri tanımlarken “tanıtım, kültür, eğlence, sanat ve sosyal paylaşım” konularının daha çok kullanıldığı; katılımcıların festivallerin sosyo-ekonomik, sosyo-kültürel, reklam ve tanıtım açılarından katkılar sunduğunu düşündükleri bulgularına ulaşılmıştır. Doğrul ve diğerleri (2015) tarafından yapılan bir diğer çalışmada, festivalin kalitesini belirleyen ‘programın, bilgilendirmenin ve alana ilişkin olanakların’ algılanan festival değeri üzerinde olumlu etkileri bulunduğu tespit edilmiştir. Mısırlı ve Özdemir’in (2018) festivallerin yerel halka olan etkilerinin belirlemeye yönelik yapılan çalışmada ise sosyal faydanın katılımcılar tarafından en önemli boyut olarak görüldüğü, festival ilişkin memnuniyetlerinin yüksek olduğu ve düzenli şekilde festivalin gerçekleştirilmesini bekledikleri bulgularına ulaşılmıştır. Bu kapsamda, son yıllarda festivallere yönelik akademik çalışmaların artış gösterdiği de dikkat çekmektedir.

3. ARAŞTIRMA

3.1. Amaç

Bu çalışmanın amacı, İzmir ili belediyelerine bağlı olan 30 belediye tarafından düzenlenen 42 festivalin belirlenen kategoriler çerçevesinde incelemek ve genel durumu ortaya koymaktır.

3.2. Araştırma Soruları

Çalışma kapsamında aşağıda yer alan araştırma soruları kapsamında analiz yapılmıştır:

- Festivaller hangi belediyeler tarafından düzenlenmiştir?
- Festivallerin başlangıç yılları hangi tarihlerdir?
- Festivaller hangi tarih aralığında yer almaktadır?
- Festivallerin amaçları nelerdir?
- Festivaller yerel/uluslararası hangi kategoride yer almaktadır?
- Festivaller hangi mevsimlerde organize edilmektedir?
- Festivallere ilişkin duyurular hangi kanallar aracılığıyla yapılmaktadır?
- Festivallerde düzenlenen etkinlikler nelerdir?
- Festivallerin hedef kitleleri kimlerden oluşmaktadır?

3.3. Araştırma Yöntemi

Çalışmada ‘ Festivali düzenleyen belediyeler’, ‘Festivallerin başlangıç yılları’, ‘Festivallerin tarih aralıkları’, ‘Festivallerin amaçları’, ‘Festivalin yer aldığı kategori’, ‘Festival mevsimleri’, ‘Festival program duyurusu’, ‘Festival düzenlenen etkinlikler’, ‘Festival hedef kitleleri’ nden oluşan kategoriler çerçevesinde analiz yapılmıştır. Festival içeriklerine 22-31 Ekim 2018 tarihlerinde belirtilen web sitelerinden erişim sağlanmıştır.

3.4. Sınırlılıklar

- Çalışma kapsamında adına sadece festival kelimesi geçen adı ile geçen etkinliklere yönelik analiz yapılmış, şenlik veya etkinlik günleri olarak geçen organizasyonlar ele alınmamıştır.
- Çalışmada yalnızca 2017 yılında düzenlenen festivaller incelenmiştir.
- 30 belediyeden toplamda 28 belediyenin düzenlemiş olduğu festivale ulaşılmıştır. Karaburun ve Gazimir belediyelerinin düzenlemiş olduğu festivallere ulaşılamamıştır.

4. BULGULAR

Tablo 1. Festival isimleri

| | |
|---|--|
| Ot Festivali | Altın Kiraz Kültür ve Sanat Festivali |
| Çocuk Festivali | İzmir Tavuk Eti Festivali |
| Halk Dansları Festivali | Hasat Festivali |
| Çiçek Festivali | Kavacık Üzüm Festivali |
| Kermes Festivali (Türkiyenin ilk festivali) | Tiyatro Festivali |
| Geleneksel Kiraz Festivali | Gençlik ve Çiçek Festivali |
| Balkan Festivali | İnadına Tiyatro Festivali |
| Neşeli Otlar Festivali | Emiralem Çilek Festivali |
| Teknolojik Uyku Festivali | Kesme Çiçek Festivali |
| Zafer ve Barış Festivali | Deve Güreşi Festivali |
| Klasik Müzik Akademisi Festivali | Gençlik Festivali |
| Aşk Festivali | Bademli Kiraz ve Fidancılık Festivali |
| Kültür-Sanat, Bilim-Düşünce ve Emek Festivali | Tiyatro Festivali |
| Kültür,Sanat ve Balıkçılık Festivali | Efes Kültür ve Sanat Festivali |
| Payamlı Bardacık Festivali | Geleneksel Zeytin ve Zeytin Yağı Hasat Festivali |

| | |
|------------------------|--|
| Kültür Sanat Festivali | Girit'ten Tire'ye Lezzet ve Kültür Festivali |
| Çikolata festivali | Urla Enginar |
| Kahve Festivali | Ot Festivali |
| Gençlik Festivali | Gastronomi İzmir ve Yemek Festivali |
| Çocuk Festivali | Caz Festivali |
| Çiçek Festivali | Geleneksel Yemek Festivali |

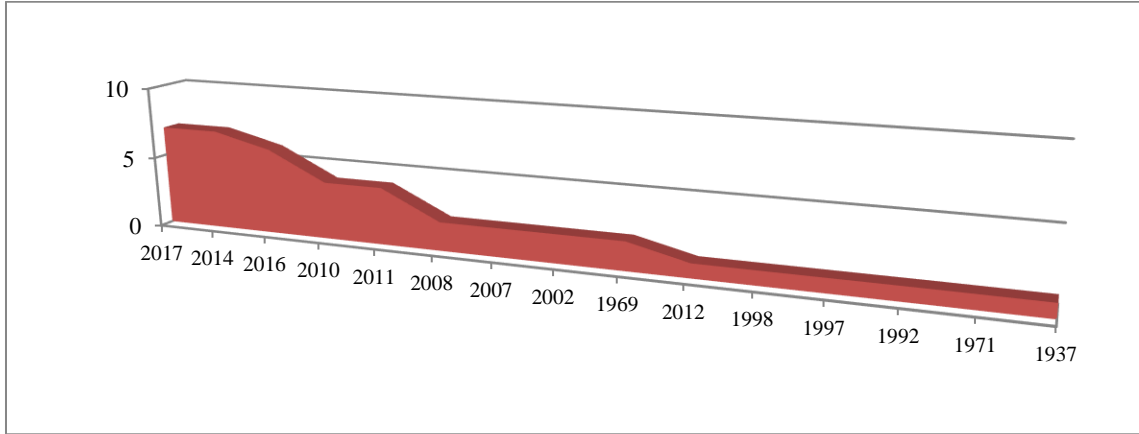
2017 yılında İzmir belediyeleri tarafından düzenlenen 42 festivalin %26,19'unun (11 festival) Doğa, %21,42'sinin (9 festival) Yemek, %14,28'inin (6 festival) Kültür-sanat, %11,90'unun (5 festival) Gençler ve çocuklar %7,14'ünün (3 festival) Tiyatro, %4,76'sının (2 festival) Müzik, %14,28'inin (6 festival) diğer kategorisinde yer aldığı görülmektedir.

Tablo 2. Festival Düzenleyen Belediyeler

| Festival Düzenleyen Belediyeler | Festival Sayısı |
|--|-----------------|
| Çeşme, Karşıyaka Belediyeleri | 2*4=8 |
| İzmir Büyükşehir, Buca, Kemalpaşa Belediyeleri | 3*3=9 |
| Menderes, Kuşadası, Menemen Belediyeleri | 3*2=6 |
| Menemen, Urla Belediyeleri | 2*2=4 |
| Aliğa, Balçova, Bayındır, Bergama, Bornova, Çiğli, Dikili, Foça, Güzelbahçe, Kınık, Karabağlar, Narlıdere, Ödemiş, Seferihisar, Selçuk, Torbalı, Tire Belediyeleri | 1*17=17 |

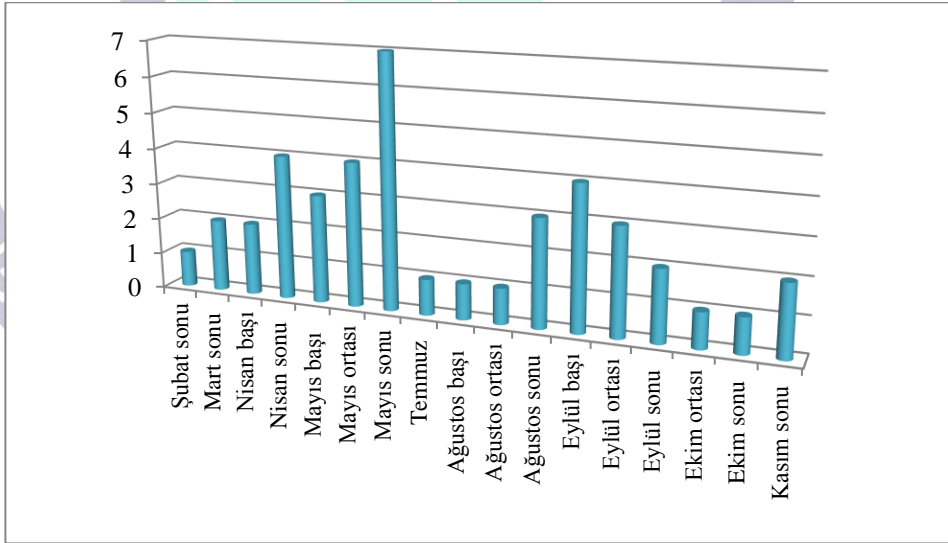
Festival düzenleyen belediyeler incelendiğinde, en fazla festivalin Çeşme ve Karşıyaka belediyeleri tarafından (4'er festival) düzenlendiği görülmüştür. Bu belediyeleri takiben, Buca, İzmir Büyükşehir ve Kemalpaşa belediyeleri tarafından 3'er festival; Menderes, Kuşadası Menemen ve Urla belediyeleri tarafından ise 2'şer festival organize edildiği görülmüştür. Aliğa, Balçova, Bayındır, Bergama, Bornova, Çiğli, Dikili, Foça, Güzelbahçe, Kınık, Karabağlar, Narlıdere, Ödemiş, Seferihisar, Selçuk, Torbalı ve Tire belediyeleri tarafından 1'er festival düzenlenmiştir.

Grafik 1. Festivallerin Organize Edildikleri Yıllar



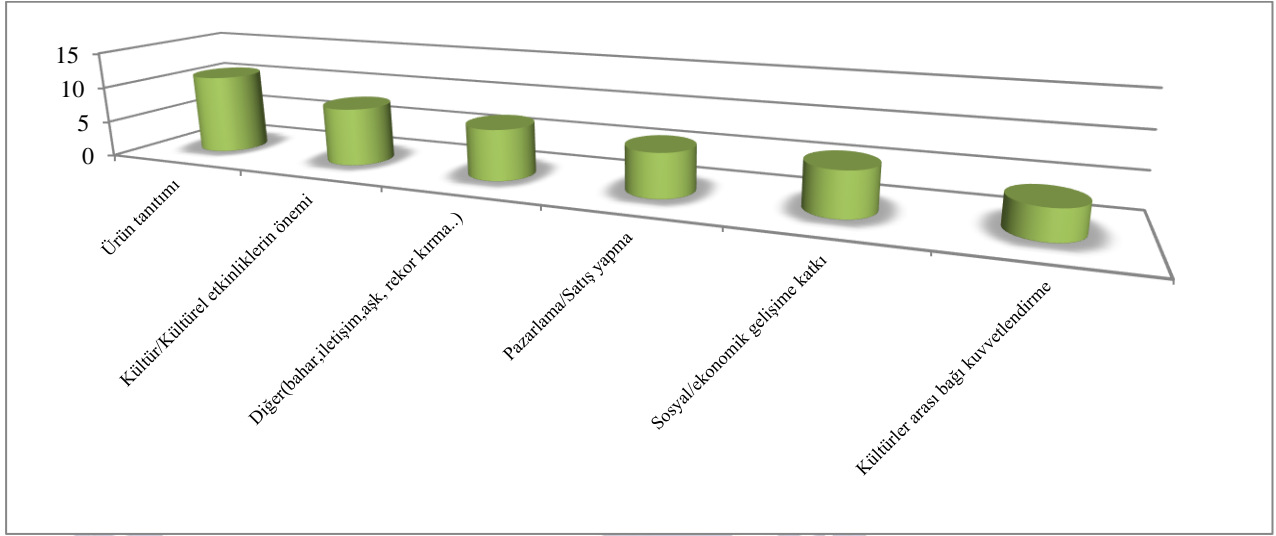
İzmir'de 2017 yılına kadar düzenlenen festivallerin dağılımı incelendiğinde; 2014 yılında 7, 2017 yılında 7, 2016 yılında 6, 2010 yılında 4, 2011 yılında 4, 2002 yılında 2, 2008 yılında 2, 1969 2, 2007 2, 2012 1, 1998 1, 1997 1, 1992 1, 1971 1, 1937 1 adet festivalin düzenlenmiş olduğu görülmektedir.

Grafik 2. Festivallerin Organize Edildikleri Zaman Dilimleri



Festivallerin düzenlenmiş olduğu aylar incelendiğinde; Şubat sonu 1, Mart sonu 2, Nisan başı 2, Nisan sonu 4, Mayıs başı 3, Mayıs ortası 4, Mayıs sonu 7, Temmuz başı 1, Ağustos başı 1, Ağustos ortası 1, Ağustos sonu 3, Eylül başı 4, Eylül ortası 3, Eylül sonu 2, Ekim ortası 1, Ekim sonu 1, Kasım sonu 2 festivalin organize edilmiş olduğu; Ocak ve Haziran aylarında organize edilen herhangi bir festivalin olmadığı görülmüştür.

Grafik 3. Festivallerin Amaçları



Çalışma kapsamında incelenen 42 festivalin %26,19'unun (11 festival) tanıtım, %19,04'ünün (8 festival) Kültür/Kültürel etkinlikler, %16,66'sının (4 festival) Diğer (bahar coşkusu, ünlülerle bir araya gelme, mangal rekoru, gençleri motive etme, aşk,iletişim), %14,28'inin (6 festival) sosyal/ekonomik gelişime katkı, %14,28'inin (6 festival) Pazarlama/Satış, %9,52'sinin (4 festival) Kültürler arası baği kuvvetlendirme amacıyla organize edilmiş olduğu görülmektedir.

Tablo 2. Festival Türü

| Tür | Sayı | Yüzde |
|--------------|------|--------|
| Yerel | 32 | %76,19 |
| Uluslararası | 10 | %23,80 |
| Toplam | 42 | %99,99 |

Festivallerin türlerine bakıldığında; 42 Festivalin %76,19'unun (32 festival) yerel düzeyde, %23,80'inin (10) ise uluslararası düzeyde olduğu görülmüştür.

Tablo 3. Festival Mevsimi

| Mevsim | Sayı | Yüzde |
|----------|------|--------|
| Sonbahar | 13 | %30,95 |
| Kış | 2 | %4,76 |
| Bahar | 21 | %50 |
| Yaz | 6 | %14,28 |
| Toplam | 42 | %99,99 |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Çalışma kapsamında incelenen festivallerin %50'sinin (21 festival) bahar, %30,95'inin (13 festival) sonbahar, %14,28'inin (6 festival) yaz, %4,76'sının (2 festival) ise kış mevsiminde organize edildiği görülmektedir.

Tablo 4. Festival Bilgilerinin Duyurulması

| Duyuru aracı | Sayı | Yüzde |
|--------------------------------------|------|--------|
| Belediye web sayfası | 25 | %59,52 |
| Yazılı basın (Gazete) | 6 | %14,28 |
| Belediye sayfası ve Facebook | 8 | %19,04 |
| Gazete ve Facebook | 1 | %2,38 |
| Belediye sayfası, Gazete ve Facebook | 1 | %2,38 |
| Facebook | 1 | %2,38 |
| Toplam | 42 | %99,98 |

Çalışma kapsamında incelenen festivallere ilişkin bilgilerin %59,52'sinin (25 festival) belediye web sayfasında, %19,04'ünün (8 festival) belediye web sayfası ve Facebook'ta, %14,28'inin (6 festival) gazetede, %2,38'inin (1 festival) gazete ve Facebook'ta, %2,38'inin (1 festival) belediye web sayfasında, gazete ve Facebook'ta, %2,38'inin (1 festival) sadece Facebook'ta duyurulduğu görülmüştür.

Tablo 5. Festivaldeki Etkinlikler

| Etkinlikler | Sayı |
|--|------|
| Atölye | 4 |
| Söyleşi | 6 |
| Kortej | 6 |
| Yarışma | 14 |
| Dans, Halk oyunları, Tiyatro, Mehteran Gösterileri | 15 |
| Konserler | 23 |
| Defile | 2 |
| Müzik dinletileri, workshop | 5 |
| Diğer (yürüyüş, kitap okuma, film gösterimi, ödül töreni, sokak oyunları, sergi, panel, spor etkinlikleri) | 8 |

Çalışma kapsamında incelenen festivallerdeki etkinliklerde konserlerin (23 festival) birinci sırada, dans, halk oyunları, tiyatro, mehteran gösterilerinin (15 festival) ikinci sırada ve yarışmaların (14 festival) üçüncü sırada yer aldığı görülmektedir.

Tablo 6. Festivallerin Hedef Kitleleri

| Bireyler | Sayı | Yüzde |
|--|-------------|--------------|
| 7'den 70'e halk | 28 | %66,66 |
| Aşçılar/Şefler | 2 | %4,76 |
| Öğrenciler/Gençler/Çocuklar | 7 | %16,66 |
| Diğer (üreticiler (1), göçmenler (2), firmalar (1), yabancı turistler (1)) | 5 | %11,90 |
| Toplam | 42 | %99,98 |

Çalışma kapsamındaki festivallerin hedef kitleleri içinde %66,66 oranla 7'den 70'e halkın, %16,66 oranla öğrenciler, gençlerin ve çocukların, %11,90 oranla diğer kitlelerin, %4,76 oranla ise aşçılar ve şeflerin olduğu görülmektedir.

4. SONUÇLAR

Araştırma kapsamında ortaya çıkan sonuçlar şu şekildedir;

- İzmir belediyeleri tarafından düzenlenen festivallerin %21,42 oranla doğa konulu olduğu, müzik, tiyatro ile ilgili yapılan festivallerin sayısının az olduğu,
- En çok festival düzenleyen belediyelerin Çeşme ve Karşıyaka olduğu Aliğa, Balçova, Bayındır, Bergama, Bornova, Çiğli, Dikili, Foça, Güzelbahçe, Kınık, Karabağlar, Narlıdere, Ödemiş, Seferihisar, Selçuk, Torbalı, Tire belediyelerinin düzenlendiği festival sayılarının 1'er adet olduğu,
- Türkiye'de ve İzmir'de ilk düzenlenen festivallerin 1937 yılında yapılmış olduğu; festivallerin artış gösterdiği yılların ise 2014 ve 2017 yıllarında olduğu,
- Festivallerin en çok Mayıs sonunda (7 festival) ve Eylül başında (4 festival) organize edildiği, Ocak ve Haziran aylarında ise herhangi bir festival organizasyonu olmadığı,
- Festivallerin %76,19'unun yerel düzeyde olduğu, uluslararası nitelikte festivallerin sayıca artırılması gerektiği,
- Festivallerin %50 oranında bahar ayında organize edildiği, Yaz ve Kış döneminde festival sayısının oldukça düşük olduğu ve bu dönemlerde farklı temalı festivallerin organize edilebileceği,

- Festivallerin duyurusunda belediye web sayfalarının yoğun olarak kullanılmış olduğu, sosyal medya araçlarında ise Facebook'un kullanıldığı,
- Festivalin hedef kitlesinde 7' den 70'e halka hitap edildiği ancak spesifik konularda düzenlenen festivallerin toplumun farklı demografik ve sosyografik gruplarında yer alan bireylere ulaşmanın bir yolu olarak kullanıldığı söylenebilir.

Ortaya çıkan sonuçlar doğrultusunda, kitleler ile olan iletişimde sosyal medya kanallarının kullanımında Facebook'un ön plana çıktığı görülmüştür. Ancak, Twitter ve Instagram gibi diğer sosyal medya araçlarının da kullanımına ağırlık verilmesi, kitlelerle olan iletişimin verimliliğini daha çok arttıracaktır. Buna ek olarak, uluslararası kapsamda festival sayısının oldukça az olduğu bu noktada da ülkenin ve ülkenin kültürel özelliklerinin tanıtımı noktasında uluslararası festivallerin artırılması gerektiği söylenebilir. Diğer bir taraftan, yapılan festivallerin ölçülenmesine yönelik istatistiki veriler elde edilememiştir. Bu kapsamda festivalleri organize eden belediyelerin kitlelerden geri bildirim alması, belediyelerin gelecekte düzenleyecekleri festivaller açısından önemli doneler sunacaktır.

Çalışmada, İzmir ilinde düzenlenen festivallerin genel durumuna yönelik analiz yapılmıştır. Gelecekte konu ile ilgili yapılacak araştırmalarda; Ege bölgesinin diğer illerinde yapılan festivaller ele alınarak daha kapsamlı bir çalışma yapılabilir. İzmir ilinde nicel bir araştırma kapsamında halk tarafından festivallerin nasıl algılandığı ve hangi duyguları uyandırdığı üzerine araştırmalar yürütülebilir.

KAYNAKÇA

- Andersson, T. D. ve Getz, D. (2008) "Stakeholder Management Strategies of Festivals", *Journal of Convention & Event Tourism*, 9(3): 199-220.
- Atak, O., Tatar, S. ve Tunaseli, A. (2017) "Kültürel Miras Oluşumunda Festivallerin Yeri ve Önemi: Fethiye Müzik Köyü Üzerine Bir Değerlendirme", *Journal of International Social Research*, 10(52): 1396-1409.
- Bilgili, B., Yağmur, Ö. ve Yazarkan, H. (2012) "Turistik Ürün Olarak Festivallerin Etkinlik ve Verimliliği Üzerine Bir Araştırma (Erzurum- Oltu Kırdağ Festivali Örneği)", *Uluslar arası Sosyal ve Ekonomik Bilimler Dergisi*, 2: 117-124.
- Çulha, O. (2008) "Kültür Turizmi Kapsamında Destekleyici Turistik Ürün Olarak Deve Güreşi Festivalleri Üzerine Bir Alan Çalışması", *Journal of Yaşar University*, 3(12): 1826-1852.
- Dalgın, T., Atak, O. ve Çeken, H. (2016) "Festivallerin Bir Kırsal Turizm Çekiciliği Olarak Önemi", *Uluslar arası Sosyal Araştırmalar Dergisi*, 9(47): 1179-1184.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Erdem, Ö., Mızrak, M. ve Aratoğlu, C. (2018) “Festivallerin Bölge Turizmine Katkıları ve Sürdürülebilirliği: Uluslar arası Mengen Aşçılık ve Turizm Festivali Örneği”, Journal of Tourism and Gastronomy Studies, 6(1): 228-245.

Frisby, W. ve Getz, D. (1989) “Festival Management: A Case Study Perspective”, Journal of Travel Research, 28(1): 7-11.

Gül, K., Erdem, B. ve Gül, M. (2013) “Yerel Festivallerin Etkinliğine Bağlı Ziyaretçi Kazanımları: Sındırgı Yağcı Bedir Festivali Örneği”, Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 18(2): 213-239.

<http://cesme.bel.tr/etkinlik/8-alacati-ot-festivali-6-9-nisan-2017-809089>

<https://www.kulturportali.gov.tr/turkiye/izmir/etkinlik/uluslararasi-halk-danslari-festivali>

<https://www.facebook.com/events/598291213709269/>

<https://www.bornova.bel.tr/etkinlik/4-geleneksel-bornova-kiraz-festivali/>

<http://www.buca.bel.tr/Haberler/1129/buca-balkan-festivali--ne-hazirlaniyor.html>

<http://www.buca.bel.tr/Haberler/1098/buca-belediyesi-2-teknolojik-uyku-festivali-basvurulari-basladi.html>

<http://cesme.bel.tr/etkinlik/uluslararasi-cesme-klasik-muzik-akademisi-ve-festivali>

<http://guzelbahce.bel.tr/index.php/hizli-menu/haberler/148-5-payamli-bardacik-festivali-coskusu>

<http://cesme.bel.tr/etkinlik/3-ask-festivali-dalyan-21-22-ekim-2017>

<http://www.menemen.bel.tr/guncel.asp?haberid=2114>

<http://www.menderes.bel.tr/etkinlikler/festivaller/deve-guresi-festivali>

<https://www.cesme.bel.tr/haber/6-ildiri-kultur-ve-sanat-festivali-basliyor>

<http://urlaenginarfestivali.com/etkinlik>

<http://izmir-kemalpassa.bel.tr/Etkinlikler/1042/1--geleneksel-uluslararasi-yemek-festivali>

<http://kinik.bel.tr/ilcemizde-ilk-kez-hasat-festivali-yapilacak/>

http://www.foca.bel.tr/haber-10010_FO%C3%87A_FEST%C4%B0VAL%C

[4%B0E2%80%99NDE_MUHTE%C5%9EEM_F%C4%B0NAL.aspx#ad-image-3](http://www.foca.bel.tr/haber-10010_FO%C3%87A_FEST%C4%B0VAL%C4%B0E2%80%99NDE_MUHTE%C5%9EEM_F%C4%B0NAL.aspx#ad-image-3)

<http://seferihisar.bel.tr/tyatro-festivali-basliyor/>

<http://www.selcuk.bel.tr/icerik/102/4428/48-selcuk-efes-kultur-ve-sanat-festivali-basliyor.aspx>

<http://www.kusadasi.bel.tr/haber-kusadasi-belediyesi-1-tyatro-festivali-basladi>

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Kargılioğlu, Ş. ve Kabacık, M. (2017) "Gastronomi Turizmi Kapsamında Urla Enginar Festivaline Gelen Turistlerin Festival", Journal of Tourism and Gastronomy Studies, 5(3): 409-421.
- Mısırlı, İ. ve Özdemir, H. (2018) "Festivallerin Yerel Halk Üzerindeki Sosyal Etkileri Üzerine Bir Araştırma: Ilgaz Dağı", Journal of Tourism and Gastronomy Studies, 6(2): 419-435.
- Özkan, E., Curkan, S. C. ve Sarak, E. C. (2015) "Festivallerin Katılan Ziyaretçiler Üzerine Etkileri: Alaçatı Ot Festivali Örneği", Gümüşhane Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Elektronik Dergisi, 6(14): 59-69.
- Penpece, D. (2014) "Festivallerin Pazarlanması: Türkiye'deki Uluslar arası Festivaller Üzerinde Bir Araştırma", Çukurova Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, 23(1): 193-210.
- Şengül, S. ve Genç, K. (2016) "Festival Turizmi Kapsamında Yöresel Mutfak Kültürünün Destekleyici Ürün Olarak Kullanılması: Mudurnu İpekyolu Kültür Sanat ve Turizm Festivali Örneği", Pamukkale Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi, 23: 79-89.
- Sert, A. N., (2017) "Yerel Halkın Festivallerin Başarı Faktörlerini Algılamalarına Yönelik Bir Çalışma: Beypazarı Örneği", Türk Turizm Araştırmaları Dergisi, 1(2): 29 - 44.
- Tayfun, A. ve Arslan, E. (2013) "Festival Turizmi Kapsamında Yerli Turistlerin Ankara Alışveriş Festivali'nden Memnuniyetleri Üzerine Bir Araştırma", İşletme Araştırmaları Dergisi, 5(2): 191-206.
- Uzunkaya, E. (2009) "Türkiye'nin Uluslararası Platformlardaki Tanıtım Faaliyetleri İçinde Halk Oyunları Festivallerinin Rolü", Akademik Bakış, Uluslararası Hakemli Sosyal Bilimler E-Dergisi, 16: 1-18.
- Yıldız, S. B. ve Polat, E. (2016) "Yerel Halkın Eskişehir'de Düzenlenen Festivallerin Etkilerine Yönelik Algıları", Journal of Tourism and Gastronomy Studies, 4 (2): 40-62.

**ULUSLARARASI HİZMETLER TİCARETİ REKABET GÜCÜ ÜZERİNE BİR
DEĞERLENDİRME: TÜRKİYE ÖRNEĞİ**

Ahmet AYDIN*

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, Türkiye'nin uluslararası hizmetler ticaretindeki rekabet gücünü, Endüstri-içi Ticaret Teorisi ve Uyarlanmış Karşılaştırmalı Üstünlükler kapsamında incelemektir. Böylece Türkiye'nin uluslararası hizmetler ticaretindeki uzmanlaşmasının temel özellikleri ortaya konabilecektir. 2017 yılı verilerine göre hizmet sektörü, Türkiye gayrisafi yurtiçi hasılasının yarısından fazlasını (%53) oluşturmakta olup Türkiye açısından son derece önemli bir sektördür. Ancak, hizmetlerin büyük ölçüde uluslararası ticarete konu olamadığı da bilinmektedir. Ticarete konu olabilen hizmetlerin gelir ve giderlerinden oluşan hizmetler bilançosu, Türkiye'nin ödemeler bilançosunda, yıllardır pozitif bakiye veren, böylece cari açığın düşürülmesine önemli katkı sağlayan bir cari işlemler alt hesap grubudur.

Görünmez ticaret adı da verilen hizmetler bilançosu bakiyesi, 2017 yılında 19.9 milyar dolar (43.6 milyar dolar gelir, 23.7 milyar dolar gider), 2018 Ocak-Eylül döneminde 18.9 milyar dolar fazla vermiştir (36.5 milyar dolar gelir, 17.5 milyar dolar gider). Cari işlemler açığının 2017'de 47.3 milyar dolar ve 2018 Ocak-Eylül döneminde 29.9 milyar dolar olduğu dikkate alındığında, 2017 yılında 19,9 milyar dolar, 2018 yılında da 18.9 milyar dolarlık hizmetler bilançosu fazlasının, cari açığın düşürülmesine büyük katkı sağladığı anlaşılmaktadır.

Bu kapsamda, gerek milli gelirden aldığı büyük pay, gerekse cari açığın daraltılmasındaki rolü dikkate alındığında, Türkiye'nin ticari hizmetlerdeki rekabet gücünün değerlendirilmesi büyük önem taşımaktadır. Türkiye'nin uluslararası hizmetler ticaretindeki rekabet gücü, Endüstri-içi Ticaret ve Uyarlanmış Karşılaştırmalı Üstünlükler (RCA) endeksleri ile değerlendirilmiştir. Literatürdeki analizlerin çok büyük bölümünde RCA hesaplamaları, uluslararası mal ticareti bakımından ele alınmıştır. Bu kapsamda bu çalışmanın literatüre önemli katkılarından biri, Türkiye bakımından uluslararası hizmetler ticaretindeki RCA değerleri hesaplanarak, uzmanlaşma ve işbölümü temelinde bir üstünlüğe sahip olup olmadığı, diğer bir ifade ile rekabet gücü incelenmiş olacaktır. Ayrıca endüstri-içi ticaret oranlarının değerlendirilmesi, daha önce yapılan analizlerdeki eğilimin korunup korunmadığını, zaman içinde endüstri içi ticaretin artıp artmadığını ortaya koyacaktır. Elde edilen bulgular kapsamında çeşitli politika önerilerinde bulunulacaktır.

* Doç.Dr., Bandırma Onyedi Eylül Üniversitesi, İİBF, Bandırma, Balıkesir/TÜRKİYE. aaydin@bandirma.edu.tr

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Anahtar Kelimeler: Türkiye, Hizmetler ticareti, Uluslararası rekabet gücü, Endüstri içi ticaret, RCA endeksi

JEL Kodları: F14, L83, F32.

AN EVALUATION ON THE COMPETITIVENESS OF INTERNATIONAL TRADE IN SERVICES: A CASE STUDY OF TURKEY

ABSTRACT

The purpose of this study is to analyze the competitiveness (comparative advantages) of Turkey in international trade in services in the context of Intra Industry Trade and Revealed Comparative Advantages, so it will demonstrate the basic features of specialization in international trade in services for Turkey. According to the data of 2017, the services sector has more than half of the gross domestic product of Turkey, so it is extremely important. However, it is known that a lot of services cannot be subject of the international trade (non-tradable). The services balance sheet consists of revenues and expenses of the international trade in services, giving a positive balance for many years, so it is an important sub-account group of current account that makes an important contribution to reduce the current account deficit in Turkey.

Balance of services which is also called as invisible trade gave \$ 19.9 billion surplus in 2017, and \$ 18.9 billion surplus in January-September 2018. Considering the current account deficit that was \$ 47.3 billion in 2017 and \$ 29.9 billion in January-September 2018, it is understood that the balance of services contributed in a great amount to the reduction of the current account deficit.

In this context, this paper has attempted to evaluate the competitiveness of international trade in commercial services in Turkey. In order to find out international services trade competitiveness of Turkey, Intra Industry Trade and Revealed Comparative Advantages (RCA) indices has been calculated. Intra industry trade and RCA indices reflect whether a country has comparative advantage on the basis of product differentiation, scale economies, specialization, and division of labor within its foreign trade with the other country/country groups. Especially RCA calculations in the most of the studies in the literature have been discussed in terms of trade in international goods. In this context, one of the most important contribution of this paper to the literature is the pioneering study that attempts the calculating RCA values for international trade in services. In addition, the assessment of intra-industry trade rates will show whether the trend in previous analyzes has been maintained and intra-industry trade has increased over the time. And also, various policy proposals will be made within the scope of the findings.

Keywords: Turkey, Services trade, international competitiveness, Intra industry trade, RCA index

JEL Codes: F14, L83, F32.

1.GİRİŞ

2017 yılı verilerine göre hizmet sektörü, Türkiye İktisadi Faaliyet Kollarına Göre Gayri Safi Yurtiçi Hasıla'sının yarısından fazlasını (%53,4) oluşturmakta olup, sanayi ve tarım sektörlerinden çok daha yüksek bir paya sahiptir. Türkiye ekonomisi açısından sektörel sıralamada birinci sırada yer alan hizmetlerin, büyük ölçüde uluslararası ticarete konu olamadığı da bilinmektedir. Ticarete konu olabilen hizmetlerin gelir ve giderlerinden oluşan hizmetler bilançosu, Türkiye'nin ödemeler bilançosunda, yıllardır pozitif bakiye veren, böylece cari açığın düşürülmesine önemli katkı sağlayan bir cari işlemler alt hesap grubudur.

Merkez Bankası (2018) verilerine göre, Türkiye'nin "Dış Ticaret Dengesi"; 2017 yılında 59 milyar \$ (166 milyar \$ ihracat, 225 milyar \$ ithalat), 2018 Ocak-Eylül döneminde ise 41 milyar \$ (128 milyar \$ ihracat, 169 milyar \$ ithalat) açık vermiştir. Buna karşılık "Görünmez Ticaret" adı da verilen "Hizmetler Bilançosu" bakiyesi, 2017 yılında 19.9 milyar \$ (43.6 milyar \$ gelir, 23.7 milyar \$ gider), 2018 Ocak-Eylül döneminde de 18.9 milyar \$ fazla vermiştir (36.5 milyar \$ gelir, 17.5 milyar \$ gider). Cari işlemler açığının 2017'de 47.3 milyar \$ ve 2018 Ocak-Eylül döneminde 29.9 milyar \$ olduğu dikkate alındığında, 2017 yılında 19,9 milyar \$, 2018 yılında da 18.9 milyar \$ hizmetler bilançosu fazlasının, cari açığın düşürülmesine büyük katkı sağladığı anlaşılmaktadır.

Tarafımızdan yapılan hesaplamalara göre; hizmet gelirlerinin, ticari mal ihracatına oranı 2017'de %26, 2018 Ocak-Eylül döneminde %29 olarak gerçekleşmiştir. Bu oranlar, hizmet gelirlerinin ticari mal ihracatının yaklaşık 1/3'üne karşılık geldiğini yani oldukça önemli bir büyüklüğe sahip olduğunu ortaya koymaktadır. Burada dikkati çeken önemli bir diğer husus da, 1996 yılından beri Türkiye'nin hizmetler bilançosu bakiyesinin, yaşanan kriz yılları da dahil fazla vermesi ve hiç açık vermemesidir. Altta tablodaki Hizmetler bilançosunun yıllar itibarıyla gelişimi görülmektedir. 1996 yılından beri bakiyesi sürekli pozitifdir.

Tablo 1. Türkiye Hizmetler Bilançosu Bakiyesinin Gelişimi (1996-2018)

| Yıllar | Net Hiz.Tic. (milyar \$) | Yıllar | Net Hiz.Tic. (milyar \$) | Yıllar | Net Hiz.Tic. (milyar \$) |
|--------|-----------------------------|--------|-----------------------------|------------|-----------------------------|
| 1996 | 6.7 | 2004 | 12.7 | 2012 | 22.6 |
| 1997 | 10.9 | 2005 | 15.9 | 2013 | 23.7 |
| 1998 | 13.4 | 2006 | 13.9 | 2014 | 26.8 |
| 1999 | 7.4 | 2007 | 14.1 | 2015 | 24.2 |
| 2000 | 11.3 | 2008 | 18.9 | 2016 | 15.3 |
| 2001 | 9.1 | 2009 | 18.7 | 2017 | 19.9 |
| 2002 | 7.9 | 2010 | 16.7 | 2018 (1-9) | 18.9 |
| 2003 | 10.4 | 2011 | 20.3 | | |

Kaynak: OECD (2018), Trade in services (indicator). doi: 10.1787/3796b5f0-en (Accessed on 22 November 2018)

Bu kapsamda, gerek milli gelirden aldığı büyük pay, gerekse cari açığın daraltılmasındaki rolü dikkate alındığında, Türkiye'nin ticari hizmetlerdeki rekabet gücünün değerlendirilmesi büyük önem taşımaktadır. Türkiye'nin uluslararası hizmetler ticaretindeki rekabet gücü, Endüstri-içi Ticaret ve Uyarlanmış Karşılaştırmalı Üstünlükler (RCA) endeksleri ile değerlendirilmiştir. Literatürdeki analizlerin çok büyük bölümünde RCA hesaplamaları, uluslararası mal ticareti bakımından ele alınmıştır. Ayrıca endüstri-içi ticaret oranlarının değerlendirilmesi, daha önce yapılan analizlerdeki eğilimin korunup korunmadığını, zaman içinde endüstri içi ticaretin artıp artmadığını, rekabet gücünün niteliğini ortaya koyacaktır.

Bu kapsamda çalışmanın amacı, Türkiye'nin uluslararası hizmetler ticaretindeki rekabet gücünü, Endüstri-içi Ticaret Teorisi ve Uyarlanmış Karşılaştırmalı Üstünlükler kapsamında incelemektir. Böylece Türkiye'nin uluslararası hizmetler ticaretindeki uzmanlaşmasının temel özellikleri ortaya konabilecektir. Birinci bölümde, hizmetler ticaretine ilişkin genel bilgilere değinilmiştir. İkinci bölümde Türkiye'nin; AB28 ve AB-28 dışındaki ülkelerle olan ticareti kapsamında hizmetler EİT ve RCA hesaplamaları-analizleri yapılmıştır. Üçüncü bölümde elde edilen veriler ve bulgular değerlendirilmiş, politika önerilerinde bulunulmuştur. Sonuç bölümü ile çalışma sonlandırılmıştır.

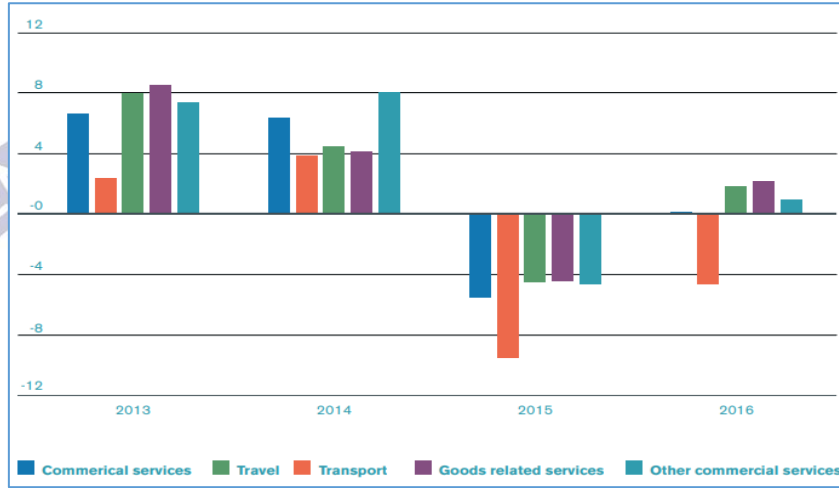
2. HİZMETLER TİCARETİNE İLİŞKİN GENEL BİLGİLER

Dünya Ticaret Örgütü Hizmetler Ticareti Genel Anlaşması (GATS) 1995 yılında yürürlüğe girmiştir. Başlangıçta, hizmetler ticareti üzerindeki kısıtlamalar şekil ve boyut değiştirerek devam etse de, belirli bir düzeyde liberalizasyon sağlanmış ve hizmetler ticareti hızla büyümeye başlamıştır. Bu süreçte en büyük faydayı gelişmiş ülkeler elde etse de, yükselen piyasa ekonomileri de kazanım sağlamış, dünya hizmet ticaretindeki paylarını %35'in üzerine çıkarmışlardır. GATS'ın hizmetler ticaretinin liberalizasyonunda önemli katkısı olduğu aşikardır. Dünya Ticaret Örgütü (WTO, 2015), hizmetler ticaretini, dünya ticaretinin en dinamik segmenti olarak nitelendirmektedir. Çünkü son yirmi yılda, mal ticaretinden çok daha hızlı büyüme göstermiştir. 2017 yılı itibarıyla dünya ticari hizmetler ihracatı 5.3 trilyon \$, dünya ticari hizmetler ithalatı da 5.1 trilyon \$ olarak gerçekleşmiştir (OECD, 2018).

Dünya ticari hizmetler ihracı; 1995 yılında 1.1 trilyon \$ iken, 2016 yılında 4.8 trilyon \$'a ulaşmıştır. Dünya ticari hizmetler ithali ise; 1995 yılında 1.2 trilyon \$ iken, 2016 yılında 4.7 trilyon \$ olmuştur. Dünya mal ihracatı 2016 yılında değer bazında yüzde 3 oranında gerilemiştir. Bu düşüş, çoğunlukla, yakıt ve madencilik ürünleri ihracatındaki düşüşten kaynaklanmıştır. 2016 yılında dünya ticaret hizmetleri ihracatı ise % 0,4 oranında artmıştır. Üstelik bu artış, ticari hizmetlerin önemli alt gruplarından küresel taşımacılık ihracatının, durgunlaşan ekonomik koşullar ve aşırı kapasite nedeniyle nakliye ve havayolu endüstrilerini vurmasına ve düşmeye devam etmesine rağmen gerçekleşmiştir (WTO, 2017: 28-64).

Hizmetler ihracatının alt gruplara göre büyüme oranları Grafik 1'de yer almaktadır. Grafiğe göre 2015 yılında tüm gruplarda büyüme hızında düşüş gözlenirken, 2016 yılında kısmi bir toparlanma olduğu dikkati çekmektedir.

Grafik 1. Kategorilere Göre Ticari Hizmetler İhracatı Büyüme Oranları (Yıllık % Değişim)



Kaynak: WTO (2017: 24)

Dünya hizmetler dış ticaretinin, seçilmiş ülke ve bölgelere göre dağılımları ile Türkiye'nin durumuna ilişkin bilgiler Tablo 2'de yer almaktadır.

Tablo 2. Hizmetler Ticareti, Milyon \$, 2010 – 2017

| Yıl | İhracat | | | | İthalat | | | |
|------|---------|-----------|-----------|-----------|---------|---------|-----------|-----------|
| | Türkiye | AB28 | OECD | Dünya | Türkiye | AB28 | OECD | Dünya |
| 2010 | 36.524 | 743.127 | 2.806.173 | 3.922.258 | 19.903 | 625.177 | 2.514.527 | 3.835.750 |
| 2011 | 41.373 | 845.763 | 3.146.639 | 4.412.872 | 21.197 | 688.013 | 2.758.416 | 4.287.126 |
| 2012 | 43.680 | 869.312 | 3.193.263 | 4.544.928 | 21.030 | 678.877 | 2.781.839 | 4.458.977 |
| 2013 | 48.295 | 951.327 | 3.408.838 | 4.838.131 | 24.564 | 726.000 | 2.916.597 | 4.726.932 |
| 2014 | 51.835 | 1.008.100 | 3.658.437 | 5.197.742 | 25.080 | 782.451 | 3.100.413 | 5.133.008 |
| 2015 | 46.797 | 941.347 | 3.471.006 | 4.937.015 | 22.620 | 789.949 | 2.962.065 | 4.847.536 |
| 2016 | 37.607 | 940.070 | 3.516.472 | 4.962.968 | 22.214 | 787.629 | 3.004.938 | 4.870.963 |
| 2017 | 43.995 | 981.335 | 3.753.478 | 5.351.191 | 24.056 | 779.596 | 3.177.099 | 5.181.675 |

Kaynak: OECD (2018)'den alınan veriler yardımıyla yazar tarafından hazırlanmıştır.

Türkiye'nin hizmet ihracatı; 2010 yılında 36.5 milyar \$ iken 2017 yılında 43.9 milyar \$'a ulaşmıştır. AB 28 üyesi ülkelerin ihracatı 2010 yılında 743 milyar \$'dan, 2017 yılında 981 milyar \$'a, OECD üyesi ülkelerin ihracatı da 2010 yılında 2.8 trilyon \$'dan, 2017 yılında 3.7 trilyon \$'a çıkmıştır. Hizmetler ithalatına bakıldığında; 2010 yılında 19.9 milyar \$ iken 2017 yılında 24 milyar \$'a ulaşmıştır. AB 28 üyesi ülkelerin ithalatı 2010 yılında 625 milyar \$'dan, 2017 yılında 779 milyar \$'a, OECD üyesi

ülkelerin ithalatı da 2010 yılında 2.5 trilyon \$'dan, 2017 yılında 3.1 trilyon \$'a çıkmıştır. 2017 yılı itibariyle, Türkiye'nin dünya hizmetler ihracatındaki payı %0,8, AB28'in payı %18 ve OECD üyelerinin payı da %70 civarındadır. Hizmetler ithalatındaki paylara bakıldığında Türkiye %0,5, AB28 %15 ve OECD %61 paya sahiptir. Türkiye, 2016 yılı itibariyle, Dünya Ticaret Örgütü öncü hizmet ihracat ve ithalatçıları sıralamasında hizmetler ihracatında 29, hizmetler ithalatında ise 39. sırada bulunmaktadır (WTO, 2017: 104). 2016 yılı itibariyle ihracatta, Norveç, Finlandiya, Brezilya, Yunanistan, Portekiz ve Çek Cumhuriyeti gibi ülkelerden daha yüksek paya sahiptir.

Tablo 3. Türkiye'nin Net Hizmet Ticareti (2010-2016)

| | 2010 | | | 2011 | | | 2012 | | | 2013 | | | 2014 | | | 2015 | | | 2016 | | |
|--|--------|--------|---------------|--------|--------|---------------|--------|--------|---------------|--------|--------|---------------|--------|--------|---------------|--------|--------|---------------|--------|--------|---------------|
| | İhr. | İth. | Net | İhr. | İth. | Net | İhr. | İth. | Net | İhr. | İth. | Net | İhr. | İth. | Net | İhr. | İth. | Net | İhr. | İth. | Net |
| S. TOPLAM EBOBS HİZMETLERİ | 36.524 | 19.903 | 16.622 | 41.373 | 21.197 | 20.177 | 43.680 | 21.030 | 22.650 | 48.295 | 24.564 | 23.730 | 51.835 | 25.080 | 26.755 | 46.797 | 22.620 | 24.177 | 37.607 | 22.214 | 15.393 |
| SA. Başkalarının Sahip Old. Fiziksel Girdiler Üz. İmalat Hizm. | .. | .. | .. | 86 | 25 | 62 | 100 | 39 | 61 | 139 | 45 | 94 | 134 | 60 | 74 | 124 | 57 | 67 | 100 | 104 | -3 |
| SB. Bakım ve Tamir Hizmetleri | .. | .. | .. | 38 | 123 | -85 | 51 | 187 | -136 | 41 | 236 | -195 | 38 | 292 | -254 | 27 | 343 | -315 | 106 | 420 | -314 |
| SC. Taşımacılık | 9.439 | 8.094 | 1.345 | 11.063 | 8.653 | 2.410 | 12.674 | 8.962 | 3.711 | 14.266 | 10.297 | 3.969 | 15.599 | 10.154 | 5.445 | 14.287 | 8.317 | 5.970 | 13.027 | 7.955 | 5.072 |
| SD. Seyahat | 22.631 | 5.206 | 17.425 | 25.120 | 4.895 | 20.225 | 25.411 | 4.104 | 21.307 | 28.054 | 4.826 | 23.227 | 29.542 | 5.070 | 24.472 | 26.685 | 5.382 | 21.303 | 7.531 | 4.773 | 2.757 |
| SE. İnşaat | 1.122 | 263 | 859 | 1.250 | 410 | 840 | 1.376 | 342 | 1.034 | 1.201 | 524 | 677 | 1.282 | 199 | 1.083 | 784 | 409 | 375 | 903 | 414 | 489 |
| SF. Sigorta ve Emeklilik Hizmetleri | 722 | 1.265 | -543 | 835 | 1.307 | -472 | 865 | 1.294 | -430 | 1.002 | 1.722 | -720 | 1.165 | 1.686 | -521 | 1.064 | 1.379 | -315 | 1.088 | 1.481 | -393 |
| SG. Finansal Hizmetler | 491 | 726 | -235 | 534 | 1.226 | -691 | 533 | 1.179 | -646 | 780 | 1.337 | -557 | 823 | 1.904 | -1.081 | 661 | 1.783 | -1.122 | 675 | 1.612 | -937 |
| SH. Fikri Mülkiyet Kullanım Ücr. | | 818 | -818 | | 682 | -682 | | 744 | -744 | | 785 | -785 | | 675 | -675 | | 683 | -683 | | 763 | -763 |
| SI. Telekomünikasyon, Bilgisayar ve Bilgi Hizmetleri | 480 | 243 | 237 | 468 | 282 | 187 | 436 | 299 | 138 | 327 | 256 | 71 | 290 | 208 | 82 | 212 | 213 | -1 | 166 | 197 | -31 |
| SJ. Diğer İşletme Hizmetleri | 244 | 1.676 | -1.433 | 200 | 1.733 | -1.533 | 262 | 1.989 | -1.728 | 398 | 2.559 | -2.161 | 343 | 2.359 | -2.016 | 250 | 1.766 | -1.517 | 623 | 2.347 | -1.723 |
| SK. Kişisel, Kültür, Rekreasyon Hizmetleri | 913 | 256 | 657 | 1.273 | 294 | 979 | 1.220 | 331 | 889 | 1.288 | 473 | 815 | 1.795 | 441 | 1.354 | 1.878 | 381 | 1.497 | 1.586 | 358 | 1.229 |
| SL. Resmi Hizmetler | 484 | 1.355 | -872 | 505 | 1.568 | -1.063 | 753 | 1.560 | -807 | 801 | 1.504 | -703 | 824 | 2.033 | -1.208 | 827 | 1.907 | -1.081 | 613 | 1.792 | -1.179 |
| Ticari Hizmetler | 36.041 | 18.547 | 17.493 | 40.868 | 19.628 | 21.239 | 42.927 | 19.470 | 23.457 | 47.494 | 23.061 | 24.433 | 51.010 | 23.047 | 27.964 | 45.970 | 20.713 | 25.257 | 36.994 | 20.422 | 16.572 |
| Diğer Ticari Hizmetler | 3.971 | 5.247 | -1.277 | 4.560 | 5.933 | -1.373 | 4.692 | 6.178 | -1.486 | 4.995 | 7.656 | -2.661 | 5.698 | 7.471 | -1.772 | 4.847 | 6.614 | -1.766 | 5.041 | 7.170 | -2.130 |
| Diğer Hizmetler | 4.454 | 6.603 | -2.148 | 5.065 | 7.501 | -2.435 | 5.444 | 7.738 | -2.294 | 5.796 | 9.159 | -3.363 | 6.522 | 9.503 | -2.981 | 5.674 | 8.521 | -2.847 | 5.654 | 8.962 | -3.308 |

*: 2016 verileri geçicidir.

Kaynak: OECD (2018)

Ticari hizmetler olarak belirtilen grup, ihracat ve ithalat bakımından toplam EBOBS hizmetlerinin %90'dan fazlasını oluşturmaktadır (ihracatta %98). Türkiye'nin hizmetler ihracatında; 2010 yılında Seyahat Hizmetleri en önemli grup olarak öne çıkarken, 2015 yılında toplam ihracatın %57'sini, 2016 yılında da %20'sini oluşturmuştur. Bu keskin düşüşün nedeni olarak; 2016 yılında gerçekleşen darbe girişimi ve Rusya ve diğer bazı ülkelerle gerilen siyasi ilişkilerin, bilhassa turizme yansması vb. sayılabilir. Taşımacılık grubu 2010 yılında %26 payla ikinci sırada gelirken, 2016 yılında toplam hizmet ihracatının %35'ini teşkil etmiştir. Diğer grupların payı nispeten küçük olup, sadece seyahat ve taşımacılık toplamı, 2016 yılında % 55'dir.

Türkiye hizmetler ithalatında; 2010 yılında taşımacılık %41 paya sahipken, 2016 yılında %36'lık orana sahiptir. Seyahat grubu 2010 yılında %26 paya sahipken, 2016 yılında %21 paya sahiptir. Aradan geçen zamanda çoğu hizmet gruplarının payında artış gözlenmiştir.

Türkiye'nin Hizmet ihracatında en yüksek paya sahip ülke 2012-2015 periyodunda Rusya iken, 2016 yılında Almanya birinci sıraya çıkmıştır (5 milyar \$). 2016 yılında Rusya'ya ihracattaki düşüş çok keskindir. Sanırız en büyük sebep uçak krizi ile gerilen ilişkilerdir. 2017 yılından itibaren yeniden Rusya'nın Türkiye'nin önemli bir hizmet ihraç pazarı olmaya başladığı görülmektedir. Bu ülkeleri yaklaşık olarak birbirine yakın değerler ile İngiltere, ABD, İtalya ve Fransa takip etmektedir.

Üretimdeki ve ulusal ekonomilerdeki ağırlığına rağmen, dış ticarete konu olma noktasında önemli uluslararası engellerle karşılaşmaktadır. Dış ticaret dendiğinde akla ilk olarak ticari mallar dış ticareti gelmektedir. “Dünya mal ve hizmet ihracatı” dendiğinde hem “ticari mallar” hem de “ticari hizmetler”(commercial services) bu kapsama girmektedir. Ancak mal ticaretinin sınıflandırılmasında kullanılan yöntemler, hizmetler ticaretinde kullanılamamaktadır. Hizmetlerin ayrı bir sınıflandırma sistemi vardır. Önceleri, Ödemeler Bilançosu Hizmetler Bilançosu ile EBOBS 2002 bazlı veriler üretilip yayınlanmaktayken, 2010 Yılından sonra EBOBS 2010 sistemine geçilmiştir. Bu sınıflandırmalar, mal ticareti kadar detaylı değildir ve verilerde önemli sorunlarla karşılaşmaktadır. UN Comtrade, WTO-UNCTAD-ITC trade in services dataset, OECD.stats, IMF Balance of Payments Manual (BPM6), Eurostat bu kapsamda veri paylaşmakta ve yayınlamaktadır. Ancak bu veriler birbiri ile çok da uyumlu ve tutarlı görünmemektedir.

2. TÜRKİYE’NİN HİZMETLER TİCARETİ REKABET GÜCÜ: EİT ve RCA Analizleri

2.1. Yöntem ve Metodoloji

Bu bölümde Türkiye'nin ticaret ortaklarıyla hizmetler endüstri içi ticareti ve uyarlanmış karşılaştırmalı üstünlükler endeksleri hesaplanmıştır. Hizmetler dış ticareti ile ilgili veriler IMF-EBOPS hizmet sınıflandırma sistemi kapsamında elde edilmiş ve kullanılmıştır. Hizmetler ticaretinde EİT ve RCA oranlarıyla ilgili hesaplamalar, bu endüstriler bazında yapılmıştır. “**Extended Balance of Payments Services Classification 2010 (EBOPS 2010)**”-Genişletilmiş Ödemeler Dengesi Hizmetler Sınıflandırması” olarak adlandırılan sınıflandırma sisteminin ana hesap grupları şöyledir:

| | |
|----|--|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri |
| SA | Başkalarının sahip olduğu fiziksel girdiler üzerinde imalat hizmetleri |
| SB | Bakım ve tamir hizmetleri |
| SC | Taşımacılık |
| SD | Seyahat |
| SE | İnşaat |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri |
| SG | Finansal hizmetler |

| | |
|----|--|
| SH | Fikri mülkiyet kullanım ücretleri |
| SI | Telekomünikasyon, bilgisayar ve bilgi hizmetleri |
| SJ | Diğer işletme hizmetleri |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri |
| SL | Resmi mal ve hizmetler |
| | Başka Yerde Sınıflanmayan Hizmetler |
| | Ticari hizmetler |
| | Diğer Ticari hizmetler |
| | Diğer Hizmetler |

Türkiye'nin hizmetler dış ticaretine ilişkin verileri OECD Stats'dan EBOPS 2010 bazlı olarak temin edilmiştir. Ancak Türkiye'nin hizmet ihracat ve ithal verilerinin alt sektörlere göre dağılımlarına ulaşılammış sadece toplam hizmetler ticaretine ilişkin genel bilgiler gelmiştir. Türkiye'nin hizmetler dış ticareti verileri, ilgili ülkelerin ticaret akımlarının tersi alınarak hesaplanmıştır. Örneğin Raportör Rusya'nın Türkiye partnerine hizmet ihracatı, Türkiye'nin Rusya'ya hizmet ithalatı olarak değerlendirilmiştir.

2.1.1. Türkiye'nin Hizmetler Endüstri İçi Ticareti

EİT Hesaplamaları, Grubel-Lloyd (GL) bireysel endüstri endeksi kullanılarak yapılmış olup, EBOBS 2010 bazlı veriler kullanılmıştır. Mal ticareti için önerilmiş olan bu endeksin, hizmetler ticaretinde kullanılmaması için bir neden yoktur. Sadece hizmetler ticaretinde toplulaştırma düzeyi yüksek olduğundan, ihtiyatlı yaklaşmak gerekmektedir.

(i) ürün grubu için, EİT'in toplam ticaret içindeki payı (Grubel and Lloyd, 1971: 497; Greenaway and Milner, 1986: 62):

$$B_i = 1 - \frac{|X_i - M_i|}{X_i + M_i} \quad \text{veya} \quad B_i = \frac{(X_i + M_i) - |X_i - M_i|}{X_i + M_i} \quad \text{dir.}$$

(1)

Eşitlikte, X_i ve M_i : sırasıyla i ürünü ihracat ve ithalatını temsil etmektedir. Bu endeks, yüzde cinsinden de ifade edilebilmektedir.

$$0 \leq B_i \leq 1 \quad \text{veya yüzde cinsinden} \quad 0 \leq B_i \leq 100$$

Endeks değeri sıfır ise tam EAT, bir ise tam EİT söz konusudur.

2.1.2. Türkiye'nin Hizmetler Ticaretindeki Uyarlanmış Karşılaştırmalı Üstünlükleri (RCA)

Uyarlanmış Karşılaştırmalı Üstünlükler, dış ticarete yönelik endüstrilerin performanslarını yansıtmakta ve ülkenin dış ticarete uzmanlaşmasına yönelik fikir vermektedir. Hangi endüstrilerde uzmanlaşmanın veya performansın arttığı, ihracat ve ithalat paylarının birbirine oranlanması ile

bulunmaktadır. Genelde mal ticareti bakımından kullanılmaktadır. Bu çalışmada hizmet endüstrilerinin ihracat ve ithalatları kapsamında hesaplamalar yapılmıştır. RCA hesaplamasında Balassa yaklaşımı esas alınmıştır. RCA analizlerine ilişkin son yıllarda yapılan çalışmalara örnek olarak; Miteva-Kacarski (2018), Javeria, Banday & Mittal (2018), Jackman, Lorde, Lowe & Alleyne (2011) ve Startienė & Remeikienė (2014) gibi örnekler verilebilir.

2010-2016 periyodunda Türkiye'nin, AB28 ve AB-28 Dışı ülkelerle olan ticareti kapsamında 4 farklı RCA endeksi tanımlanarak (RCA1, RCA2, RCA3, RCA4) sonuçlarına yer verilmiştir. Literatürde, sadece ihracat esas alınarak yapılan hesaplamalar olmakla beraber, ithalatın dikkate alındığı çalışmalar da mevcuttur. Bulguların, EİT oranları ile birlikte değerlendirilmesi planlandığından, bu çalışmada ithalat da dikkate alınmıştır. Metodolojik olarak endekslerin hesaplama yöntemleri şöyledir:

$$RCA_1 = \frac{(\sum_{EU\ 28}^{TR,i} X / \sum_{EU\ 28}^{TR} X)}{(\sum_{EU\ 28}^{TR,i} M / \sum_{EU\ 28}^{TR} M)} \quad (2)$$

$\sum_{EU\ 28}^{TR,i} X$: Türkiye'nin, AB 28'e i hizmet grubu ihracatını,

$\sum_{EU\ 28}^{TR} X$: Türkiye'nin, AB 28'e hizmet ihracatı toplamını,

$\sum_{EU\ 28}^{TR,i} M$: Türkiye'nin AB 28'den i hizmet grubu ithalatını,

$\sum_{EU\ 28}^{TR} M$: Türkiye'nin, AB 28'den hizmet ithalatı toplamını, ifade etmektedir.

RCA1 endeksi; Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile hizmetler ticareti kapsamında, ilgili hizmet grubundan AB28 ülkelere ihracatın, Türkiye'nin AB28 ülkelere toplam hizmetler ihracatına oranı, ilgili hizmet grubunda AB28 ülkelerinden yapılan ithalatın, Türkiye'nin AB28 ülkelerinden toplam hizmetler ithalatı oranına bölünmesi suretiyle hesaplanmıştır. Hem ihracat hem de ithalât dikkate alınarak, AB28 ülkeleri ile ticarete ilgili hizmet grubunun performansı ölçülmektedir.

$$RCA_2 = \frac{(\sum_{EU\ 28}^{TR,i} X / \sum_{World}^{TR} X)}{(\sum_{EU\ 28}^{TR,i} M / \sum_{World}^{TR} M)} \quad (3)$$

$\sum_{EU\ 28}^{TR,i} X$: Türkiye'nin, AB 28'e i hizmet grubu ihracatını,

$\sum_{World}^{TR} X$: Türkiye'nin, Dünya'ya hizmet ihracatı toplamını,

$\sum_{EU\ 28}^{TR,i} M$: Türkiye'nin AB 28'den i hizmet grubu ithalatını,

$\sum_{World}^{TR} M$: Türkiye'nin, Dünya'dan hizmet ithalatı toplamını, ifade etmektedir.

RCA2 endeksi; Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile hizmetler ticareti kapsamında, ilgili hizmet grubundan AB28 ülkelere ihracatın, Türkiye'nin Dünyaya yaptığı toplam hizmetler ihracatına oranı, ilgili hizmet grubunda AB28 ülkelerinden yapılan ithalatın, Türkiye'nin Dünya ülkelerinden toplam hizmetler ithalatı oranına bölünmesi ile hesaplanmıştır. Yine hem ihracat hem de ithalât kullanılarak,

ilgili hizmet grubunun AB28 ülkelerine yönelik ticareti, Türkiye'nin genel toplam ticaretine ölçeklendirilmektedir. RCA1, ilgili hizmet grubunun AB28 ülkelere yönelik performansını, Türkiye-AB28 ticareti ile kısıtlı, RCA2 ise ilgili hizmet grubunun AB28 ülkelere yönelik performansını, Türkiye'nin tüm ülkelerle ticareti yani daha geniş boyutta hesaplamaktadır.

$$RCA_3 = \frac{(\sum_{nonEU28}^{TR,i} X / \sum_{nonEU28}^{TR} X)}{(\sum_{nonEU28}^{TR,i} M / \sum_{nonEU28}^{TR} M)} \quad (4)$$

$\sum_{nonEU28}^{TR,i} X$: Türkiye'nin, AB 28 dışındaki ülkelere i hizmet grubu ihracatı,

$\sum_{nonEU28}^{TR} X$: Türkiye'nin, AB 28 dışındaki ülkelere hizmet ihracatı toplamını,

$\sum_{nonEU28}^{TR,i} M$: Türkiye'nin AB 28 dışındaki ülkelere i hizmet grubu ithalatını,

$\sum_{nonEU28}^{TR} M$: Türkiye'nin, AB 28 dışındaki ülkelere hizmet ithalatı toplamını, ifade etmektedir.

RCA3 endeksi; Türkiye'nin AB28 dışında kalan ticaret ortaklarıyla hizmetler ticareti kapsamında, ilgili hizmet grubundan AB28 dışı ülkelere ihracatın, Türkiye'nin AB28 dışında kalan ülkelere toplam hizmetler ihracatına oranı, ilgili hizmet grubunda AB28 dışı ülkelere yapılan ithalatın, Türkiye'nin AB28 dışında kalan ülkelere yaptığı toplam hizmetler ithalatı oranına bölünmesi ile hesaplanmıştır. Hem ihracat hem de ithalât dikkate alınarak, AB28 dışında kalan ülkelere ticarete, ilgili hizmet grubunun performansı ölçülmektedir.

$$RCA_4 = \frac{(\sum_{nonEU28}^{TR,i} X / \sum_{World}^{TR} X)}{(\sum_{nonEU28}^{TR,i} M / \sum_{World}^{TR} M)} \quad (5)$$

$\sum_{nonEU28}^{TR,i} X$: Türkiye'nin, AB 28 dışındaki ülkelere i hizmet grubu ihracatını,

$\sum_{World}^{TR} X$: Türkiye'nin, Dünya'ya hizmet ihracatı toplamını,

$\sum_{nonEU28}^{TR,i} M$: Türkiye'nin AB 28 dışındaki ülkelere i hizmet grubu ithalatını,

$\sum_{World}^{TR} M$: Türkiye'nin, Dünya'dan hizmet ithalatı toplamını, ifade etmektedir.

RCA4 endeksi; Türkiye'nin AB28 dışında kalan ülkelere hizmetler ticareti kapsamında, ilgili hizmet grubundan AB28 dışı ülkelere ihracatın, Türkiye'nin Dünyaya yaptığı toplam hizmetler ihracatına oranı, ilgili hizmet grubunda AB28 dışı ülkelere yapılan ithalatın, Türkiye'nin Dünya ülkelerinden toplam hizmetler ithalatı oranına bölünmesi yolu ile hesaplanmıştır. Yine hem ihracat hem de ithalat dikkate alınarak, ilgili hizmet grubunun AB28 dışı ülkelere yönelik ticareti, Türkiye'nin genel toplam ticaretine ölçeklendirilmiştir. RCA3, ilgili hizmet grubunun AB28 dışı ülkelere yönelik performansını, Türkiye-AB28 dışı ülkeler ticareti ile kısıtlı, RCA4 ise ilgili hizmet grubunun AB28 dışı

ülkelere yönelik performansını, Türkiye'nin tüm ülkelerle ticareti, yani daha geniş kapsamda ele almaktadır.

*Hesaplanan endeks değerlerinin 1'in üzerinde olması halinde ilgili endüstride uzmanlaşma olduğu ve karşılaştırmalı rekabet üstünlüğünün bulunduğu anlaşılmaktadır. İlgili gruba göre hesaplanan değer 1'den küçükse, o gruba ait ortalamanın altında kaldığı ve karşılaştırmalı üstünlüğün ortaya çıkmadığı yorumu yapılır. Yani; Eğer, $RCA > 1$ ise "Karşılaştırmalı Üstünlük Vardır", $RCA < 1$ ise "Karşılaştırmalı Üstünlük Yoktur". Genelde **RCAS** adı verilen endeks yardımıyla paya ve paydaya bir eklenip çıkarılarak, -1 ile +1 arasında kalması sağlanabilir. Bu durumda eksi değerler karşılaştırmalı üstünlük olmadığını, artı değerler ise karşılaştırmalı üstünlük olduğunu yansıtır.*

2.2. Türkiye'nin Ticari Hizmetler EİT Oranları

Ticari hizmetler endüstri içi ticaret oranları, hizmetler ticaretinin uzmanlaşma ve işbölümüne mi dayalı, yoksa ölçek ekonomileri ve hizmet farklılaşmasına mı dayalı olduğu konusunda bilgi vermektedir. 0'a yakın değerler EİT'in düşük olduğu, 1'e yakın değerler EİT'in yüksek olduğu anlamına gelmektedir.

2.2.1. Türkiye'nin AB28 Ülkeleri ile Hizmetler Ticareti Kapsamında EİT Oranları

Toplam Hizmet sektörü bakımından EİT'in giderek arttığı gözlenmektedir. 2010 yılında 0,73 olan endeks değeri, 2016 yılında 0,92'ye ulaşmıştır. Bu süreçte neredeyse her yıl yükseliş görülmüştür. Daha detaylı bakıldığında, 2016 yılında taşımacılıkta 0,72 endeks değeri gözlenirken 2010 yılından beri hiç 0,69'un altına düşmemiştir. Bakım ve tamir hizmetleri, sigorta ve emeklilik, başkalarının sahip olduğu girdiler üzerine imalat hizmetleri ve diğer işletme hizmetlerinde oldukça yüksek EİT gözlenmiştir. İnşaat hizmetlerinde 2016 yılına kadar oldukça yüksek EİT gözlenirken, 2016 yılında keskin bir düşüş vardır (0,93'den 0,69'a düşmüştür). Seyahat hizmetlerinde, 2016 yılına dek EİT gözlenememiş, 2016 yılında ise biraz arttığı görülmüştür (0,60).

2016 yılı itibariyle, Türkiye'nin AB28 ülkelerine hizmet ihracatının % 45'i seyahat, %32'si taşımacılık, %13'ü diğer işletme hizmetleri oluşturmaktadır. Türkiye'nin AB28 ülkelerinden hizmet İthalatının %23'ü seyahat, %21'i taşımacılık grubuna aittir. Kısacası, seyahat ve taşımacılık hizmet grupları, Türkiye'nin ticari hizmetler dış ticaretinde en önemli iki hizmet grubudur. Bu gruplardan seyahat hizmetlerinde nispeten düşük EİT görülmüş ancak taşımacılık grubunda yüksek EİT oranları tespit edilmiştir. Genel olarak, Türkiye'nin dışa açık hizmet sektörleri bakımından AB28 üyesi ülkeler ile rakip ekonomiler durumunda olduğu ve ticaretin genelde ölçek ekonomileri ve hizmet farklılaşması temelinde gerçekleştiğini söylemek bu kapsamda mümkündür (Tablodaki koyu renkli değerler EİT'in görüldüğünü ifade etmektedir).

Tablo 4. Türkiye'nin AB28 Ülkeleri ile Ticari Hizmetler EİT Endeksleri (2010-2016)

| EBOBS 2010 | | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|------------|--|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | 0,73 | 0,76 | 0,79 | 0,81 | 0,80 | 0,85 | 0,92 |
| SA | Başkalarının sahip olduğu fiziksel girdiler üz. imalat hizm. | 0,34 | 0,79 | 0,96 | 0,93 | 0,85 | 0,97 | 0,93 |
| SB | Bakım ve tamir hizmetleri | 0,77 | 0,37 | 0,31 | 0,73 | 1,00 | 0,95 | 0,95 |
| SC | Taşımacılık | 0,69 | 0,73 | 0,76 | 0,74 | 0,71 | 0,72 | 0,72 |
| SD | Seyahat | 0,36 | 0,32 | 0,33 | 0,37 | 0,39 | 0,46 | 0,60 |
| SE | İnşaat | 0,83 | 0,30 | 0,73 | 0,51 | 0,77 | 0,93 | 0,69 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | 0,91 | 0,58 | 0,68 | 0,40 | 0,89 | 0,95 | 0,99 |
| SG | Finansal hizmetler | 0,46 | 0,34 | 0,29 | 0,28 | 0,25 | 0,29 | 0,30 |
| SH | Fikri mülkiyet kullanım ücretleri | 0,55 | 0,21 | 0,17 | 0,14 | 0,18 | 0,30 | 0,27 |
| SJ | Telekomünikasyon, bilgisayar ve bilgi hizmetleri | 0,57 | 0,51 | 0,39 | 0,39 | 0,42 | 0,51 | 0,44 |
| SJ | Diğer işletme hizmetleri | 0,97 | 0,81 | 0,85 | 0,94 | 0,79 | 0,78 | 0,85 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | 0,99 | 0,94 | 0,48 | 0,46 | 0,61 | 0,48 | 0,54 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | 0,94 | 0,90 | 0,68 | 0,53 | 0,87 | 0,63 | 0,66 |
| X | Başka Yerde Sınıflanmayan Hizmetler | 0,96 | 0,85 | 0,68 | 1,00 | 0,50 | 0,50 | 0,36 |
| CS | Ticari hizmetler | 0,72 | 0,76 | 0,78 | 0,80 | 0,80 | 0,85 | 0,91 |
| OCS | Diğer Ticari hizmetler | 0,77 | 0,60 | 0,59 | 0,58 | 0,57 | 0,61 | 0,63 |
| OS | Diğer Hizmetler | 0,77 | 0,62 | 0,60 | 0,58 | 0,58 | 0,61 | 0,64 |

2.2.2. Türkiye'nin AB28 Dışında Kalan Ülkelerle Hizmetler Ticareti Kapsamında EİT Oranları

Toplam Hizmet sektörü bakımından EİT'in 0,50 sınırına yakın olduğu tespit edilmiştir. 2015 yılı hariç EİT oranı limit değerinin üstündedir. 2016 yılında 0,59 EİT oranı hesaplanmıştır. Alt hizmet gruplarına bakıldığında, 2016 yılında taşımacılıkta 0,78 gibi yüksek endeks değeri gözlenirken, 2010 yılından beri hiç 0,75'in altına düşmemiştir. Sigorta ve emeklilik hizmetlerinde 2010-2016 periyodunda her yıl yüksek oranda EİT gözlenirken, kişisel-kültür ve rekreasyon hizmetlerinde EİT tespit edilememiştir. Resmi mal ve hizmetler hizmet grubunda, 2012-2015 döneminde görülen EİT, 2016 yılında 0,49 endeks değeri ile sınırın altına düşmüştür ancak yine de EİT yapısı sergilediği söylenebilir. Türkiye'nin dışa açık hizmet sektörleri bakımından AB28 dışı ülkelerle rakip ekonomiler durumunda olduğu ve ticaretin genelde ölçek ekonomileri ve hizmet farklılaşması temelinde gerçekleştiğini söylemek mümkündür.

Tablo 5. Türkiye'nin AB28 Dışı Ülkelerle Ticari Hizmetler EİT Endeksleri (2010-2016)

| EBOBS 2010 | | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|------------|--|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | 0,68 | 0,58 | 0,52 | 0,56 | 0,52 | 0,48 | 0,59 |
| SC | Taşımacılık | 0,90 | 1,00 | 0,87 | 0,89 | 0,83 | 0,75 | 0,78 |
| SD | Seyahat | 0,39 | 0,33 | 0,24 | 0,24 | 0,22 | 0,25 | 0,47 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | 0,69 | 0,84 | 0,85 | 0,97 | 0,80 | 0,86 | 0,82 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | 0,28 | 0,22 | 0,23 | 0,36 | 0,26 | 0,19 | 0,22 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | 0,44 | 0,35 | 0,64 | 0,75 | 0,53 | 0,60 | 0,49 |
| CS | Ticari hizmetler | 0,63 | 0,52 | 0,47 | 0,52 | 0,46 | 0,42 | 0,52 |

2.2. Türkiye'nin Hizmetler Ticaretinde Uyarlanmış Karşılaştırmalı Üstünlükleri (RCA)

Bu bölümde, Türkiye ile AB28, AB28-dışı ülkeler bakımından hem RCA hem de RCAS endeks değerleri hesaplanmış, kolaylık olması bakımından RCAS endeks değerlerine göre yorumlanmıştır.

2.2.1. Türkiye-AB28 Hizmetler Ticareti Kapsamında RCA Analizleri

Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile hizmetler ticaretine yönelik hesaplanan RCA1 ve RCA2 endeksleri, sırasıyla Tablo 6 ve Tablo 8'de görülmektedir. Yorumlarda kolaylık olması bakımından RCAS 1 ve RCAS 2 endeksleri de sırasıyla Tablo 7 ve Tablo 9'da sunulmuştur. Koyu ve altı çizili değerler, karşılaştırmalı üstünlüğün ortaya çıktığı ana endüstri gruplarını yansıtmaktadır. Diğer bir ifade ile, pozitif değerler rekabet gücünün yüksek olduğu anlamına gelmektedir.

Tablo 6. Türkiye-AB28 Hizmetler Ticareti Kapsamında, RCA1 Endekslerinin Yıllar İtibariyle Gelişimi (2010-2016)

| Kod | Hizmet Grubu | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|-----|--|------|------|------|------|------|------|------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | | | | | | | |
| SA | Başkalanın sahip olduğu fiziksel girdiler üz. imalathizm | 0,11 | 0,40 | 0,60 | 0,60 | 0,90 | 0,70 | 0,97 |
| SB | Bakım ve tamir hizmetleri | 0,36 | 0,14 | 0,12 | 1,18 | 0,67 | 0,81 | 0,77 |
| SC | Taşınacılık | 1,09 | 1,06 | 1,06 | 1,16 | 1,21 | 1,33 | 1,51 |
| SD | Seyahat | 2,59 | 3,16 | 3,32 | 3,05 | 2,78 | 2,45 | 1,98 |
| SE | İnşaat | 0,40 | 0,11 | 0,38 | 0,23 | 0,42 | 0,64 | 0,45 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | 0,47 | 0,25 | 0,33 | 0,17 | 0,54 | 0,66 | 0,83 |
| SG | Finansal hizmetler | 0,17 | 0,13 | 0,11 | 0,11 | 0,10 | 0,13 | 0,15 |
| SH | Fikri mülkiyet kullanım ücretleri | 0,21 | 0,07 | 0,06 | 0,05 | 0,07 | 0,13 | 0,13 |
| SI | Telekomünikasyon, bilgisayar ve bilgi hizmetleri | 0,23 | 0,21 | 0,16 | 0,17 | 0,18 | 0,25 | 0,24 |
| SJ | Diğer işletme hizmetleri | 0,53 | 0,41 | 0,48 | 0,61 | 0,44 | 0,47 | 0,62 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | 0,58 | 0,68 | 0,20 | 0,20 | 0,30 | 0,23 | 0,31 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | 0,50 | 0,75 | 0,34 | 0,24 | 0,52 | 0,34 | 0,42 |
| X | Başka Yerde Sınıflandırılmayan Hizmetler | 0,53 | 0,83 | 0,34 | 0,68 | 0,23 | 0,24 | 0,19 |
| CS | Ticari hizmetler | 1,01 | 1,00 | 1,02 | 1,02 | 1,01 | 1,01 | 1,01 |
| OCS | Diğer Ticari hizmetler | 0,35 | 0,26 | 0,27 | 0,28 | 0,27 | 0,32 | 0,39 |
| OS | Diğer Hizmetler | 0,36 | 0,27 | 0,28 | 0,28 | 0,28 | 0,32 | 0,39 |

Tablo 7. Türkiye-AB28 Hizmetler Ticareti Kapsamında, RCAS1 Endekslerinin Yıllar İtibariyle Gelişimi (2010-2016)

| Kod | Hizmet Grubu | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|-----|--|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | | | | | | | |
| SA | Başkalanın sahip olduğu fiziksel girdiler üz. imalathizm | -0,79 | -0,43 | -0,25 | -0,25 | -0,05 | -0,18 | -0,01 |
| SB | Bakım ve tamir hizmetleri | -0,47 | -0,75 | -0,78 | 0,08 | -0,20 | -0,11 | -0,13 |
| SC | Taşınacılık | 0,04 | 0,03 | 0,03 | 0,07 | 0,10 | 0,14 | 0,20 |
| SD | Seyahat | 0,44 | 0,52 | 0,54 | 0,51 | 0,47 | 0,42 | 0,33 |
| SE | İnşaat | -0,43 | -0,81 | -0,45 | -0,62 | -0,41 | -0,22 | -0,38 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | -0,36 | -0,60 | -0,50 | -0,71 | -0,30 | -0,20 | -0,09 |
| SG | Finansal hizmetler | -0,71 | -0,78 | -0,80 | -0,80 | -0,83 | -0,78 | -0,74 |
| SH | Fikri mülkiyet kullanım ücretleri | -0,65 | -0,86 | -0,88 | -0,90 | -0,87 | -0,77 | -0,77 |
| SI | Telekomünikasyon, bilgisayar ve bilgi hizmetleri | -0,63 | -0,66 | -0,73 | -0,71 | -0,70 | -0,60 | -0,61 |
| SJ | Diğer işletme hizmetleri | -0,30 | -0,42 | -0,35 | -0,25 | -0,39 | -0,36 | -0,23 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | -0,27 | -0,19 | -0,66 | -0,66 | -0,54 | -0,62 | -0,53 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | -0,33 | -0,15 | -0,50 | -0,61 | -0,32 | -0,49 | -0,41 |
| X | Başka Yerde Sınıflandırılmayan Hizmetler | -0,31 | -0,09 | -0,50 | -0,19 | -0,63 | -0,61 | -0,69 |
| CS | Ticari hizmetler | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| OCS | Diğer Ticari hizmetler | -0,48 | -0,58 | -0,57 | -0,57 | -0,58 | -0,51 | -0,44 |
| OS | Diğer Hizmetler | -0,47 | -0,57 | -0,57 | -0,57 | -0,57 | -0,51 | -0,44 |

Türkiye-AB28 ülkeleri hizmetler ticaretindeki rekabet gücünü, Türkiye'nin sadece AB28 ülkeleri kapsamında hesaplayan Tablo 7'deki bilgilere göre; taşımacılık ve seyahat hizmet gruplarında, 2010-2016 periyodunda sürekli karşılaştırmalı üstünlük olduğu, Bakım ve tamir hizmetlerinde ise sadece 2013 yılında üstünlük görüldüğü sonra ise bunun kaybedildiği görülmektedir. CS-Ticari hizmetler genelinde üstünlük görülmektedir ancak üstünlük derecesi çok yüksek değildir.

Tablo 8 ve Tablo 9'da, Türkiye-AB28 hizmetler ticaretini, Türkiye'nin Dünya ile ticareti kapsamında ortaya koyan RCA2 ve RCAS 2 endeksleri görülmektedir. Tablo 9'daki bilgilere göre ; Türkiye'nin 2010-2016 periyodu genelinde, seyahat hizmet grubunda karşılaştırmalı üstünlüğü olduğu net şekilde görülmektedir. Ancak taşımacılık hizmet grubunda ; sadece 2010 ve 2016 yıllarında üstünlük görülmüş olup, derecesi de çok yüksek değildir. Geri kalan yıllarda üstünlük görülmemektedir. CS-Ticari hizmetler genelinde üstünlük görülmemektedir.

Tablo 8. Türkiye-AB28 Hizmetler Ticareti Kapsamında, RCA2 Endekslerinin Yıllar İtibariyle Gelişimi (2010-2016)

| Kod | Hizmet Grubu | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|-----|---|------|------|------|------|------|------|------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | | | | | | | |
| SA | Başkalarının sahip olduğu fiziksel girdiler üz. inalat hizm | 0,11 | 0,34 | 0,44 | 0,44 | 0,65 | 0,46 | 0,68 |
| SB | Bakım ve tamir hizmetleri | 0,34 | 0,12 | 0,09 | 0,88 | 0,48 | 0,53 | 0,54 |
| SC | Taşımacılık | 1,05 | 0,89 | 0,78 | 0,86 | 0,88 | 0,87 | 1,06 |
| SD | Seyahat | 2,48 | 2,65 | 2,46 | 2,27 | 2,00 | 1,60 | 1,39 |
| SE | İnşaat | 0,38 | 0,09 | 0,28 | 0,17 | 0,30 | 0,42 | 0,31 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | 0,45 | 0,21 | 0,25 | 0,13 | 0,39 | 0,43 | 0,58 |
| SG | Finansal hizmetler | 0,16 | 0,11 | 0,08 | 0,08 | 0,07 | 0,08 | 0,10 |
| SH | Fikri mülkiyet kullanım ücretleri | 0,20 | 0,06 | 0,05 | 0,04 | 0,05 | 0,08 | 0,09 |
| SI | Telekomünikasyon, bilgisayar ve bilgi hizmetleri | 0,22 | 0,17 | 0,12 | 0,12 | 0,13 | 0,17 | 0,17 |
| SJ | Diğer işletme hizmetleri | 0,51 | 0,35 | 0,35 | 0,45 | 0,32 | 0,31 | 0,43 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | 0,55 | 0,57 | 0,15 | 0,15 | 0,21 | 0,15 | 0,22 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | 0,48 | 0,63 | 0,25 | 0,18 | 0,37 | 0,22 | 0,29 |
| X | Başka Yerde Sınıflanmayan Hizmetler | 0,51 | 0,70 | 0,25 | 0,51 | 0,16 | 0,16 | 0,13 |
| CS | Ticari hizmetler | 0,96 | 0,84 | 0,75 | 0,76 | 0,73 | 0,66 | 0,70 |
| OCS | Diğer Ticari hizmetler | 0,34 | 0,22 | 0,20 | 0,21 | 0,19 | 0,21 | 0,27 |
| OS | Diğer Hizmetler | 0,34 | 0,23 | 0,20 | 0,21 | 0,20 | 0,21 | 0,27 |

Tablo 9. Türkiye-AB28 Hizmetler Ticareti Kapsamında, RCAS2 Endekslerinin Yıllar İtibariyle Gelişimi (2010-2016)

| Kod | Hizmet Grubu | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|-----|--|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | | | | | | | |
| SA | Başkalarının sahip olduğu fiziksel girdiler üz. imalat/hizm. | -0,80 | -0,50 | -0,39 | -0,38 | -0,21 | -0,37 | -0,19 |
| SB | Bakım ve tamir hizmetleri | -0,49 | -0,79 | -0,84 | -0,06 | -0,35 | -0,31 | -0,30 |
| SC | Taşımacılık | 0,02 | -0,06 | -0,12 | -0,07 | -0,07 | -0,07 | 0,03 |
| SD | Seyahat | 0,42 | 0,45 | 0,42 | 0,39 | 0,33 | 0,23 | 0,16 |
| SE | İnşaat | -0,44 | -0,84 | -0,57 | -0,71 | -0,53 | -0,41 | -0,53 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | -0,38 | -0,65 | -0,60 | -0,77 | -0,44 | -0,39 | -0,27 |
| SG | Finansal hizmetler | -0,72 | -0,81 | -0,85 | -0,85 | -0,87 | -0,85 | -0,81 |
| SH | Fikri mülkiyet kullanım ücretleri | -0,66 | -0,88 | -0,91 | -0,92 | -0,91 | -0,85 | -0,83 |
| SI | Telekomünikasyon, bilgisayar ve bilgi hizmetleri | -0,64 | -0,70 | -0,79 | -0,78 | -0,77 | -0,72 | -0,71 |
| SJ | Diğer işletme hizmetleri | -0,32 | -0,48 | -0,48 | -0,38 | -0,52 | -0,53 | -0,39 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | -0,29 | -0,27 | -0,74 | -0,74 | -0,65 | -0,73 | -0,65 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | -0,35 | -0,23 | -0,60 | -0,69 | -0,45 | -0,64 | -0,55 |
| X | Başka Yerde Sınıflanmayan Hizmetler | -0,33 | -0,18 | -0,60 | -0,33 | -0,72 | -0,72 | -0,77 |
| CS | Ticari hizmetler | -0,02 | -0,08 | -0,14 | -0,13 | -0,16 | -0,20 | -0,17 |
| OCS | Diğer Ticari hizmetler | -0,49 | -0,64 | -0,66 | -0,66 | -0,67 | -0,65 | -0,57 |
| OS | Diğer Hizmetler | -0,49 | -0,63 | -0,66 | -0,66 | -0,67 | -0,65 | -0,57 |

Türkiye-AB28 hizmetler ticareti, Türkiye-AB28 ticareti kapsamında ele alındığında ; taşımacılık ve seyahat hizmet gruplarında, inceleme dönemi boyunca karşılaştırmalı üstünlük bulunurken, Türkiye'nin Dünya ile ticareti kapsamında ele alındığında, inceleme dönemi boyunca seyahat hizmet grubunda karşılaştırmalı üstünlük görülmüştür. Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile ticaretinde taşımacılık hizmet grubundaki üstünlüğü; Türkiye'nin dünya ile ticareti kapsamında ele alındığında nispeten kaybolmaktadır.

Türkiye-AB28 ülkeleri ile 'CS- Ticari hizmetler' ticaretinde karşılaştırmalı üstünlük görülmektedir ancak üstünlük derecesi çok yüksek değildir, Türkiye'nin Dünya ile ticareti dikkate alındığında bu üstünlük ortadan kalkmaktadır.

Son olarak bu bölümde hizmet gruplarının Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile ticaretindeki ağırlıklarını dikkate alarak açıklamalarımızı tamamlayabiliriz. Türkiye-AB28 ülkeleri hizmetler ihracatında; 2010 yılında taşımacılık %25, seyahat %55 paya sahip iken, 2016 yılında bu değerler sırasıyla %32 ve %45'dir. Bu iki grubun toplamı, toplam ticaretin %75'den fazlasını oluşturmaktadır. İthalat açısından bakacak olunursa ; 2010 yılında Türkiye'nin AB28 ülkelerinden hizmet ithalinin %23'ü taşımacılık, %21'i seyahat, %19'u diğer işletme hizmetlerine ait iken, 2016 yılında bu oranlar sırasıyla %21, %23 ve %21 olarak gerçekleşmiştir. Seyahat ve taşımacılık hizmetleri ithalatı, AB28'den toplam hizmet ithalatının %44'ünü teşkil etmiştir.

2.2.2. Türkiye'nin AB-Dışı Ülkelerle Ticaretinde RCA Endeksleri

Türkiye'nin AB dışı ülkeler ile hizmetler ticaretine yönelik hesaplanan RCA3 ve RCA4 endeksleri, sırasıyla Tablo 10 ve Tablo 12'de görülmektedir. Yine yorumlarda kolaylık olması bakımından RCAS3 ve RCAS4 endeksleri, sırasıyla Tablo 11 ve Tablo 13'de sunulmuştur. Koyu ve altı çizili değerler, karşılaştırmalı üstünlüğün ortaya çıktığı ana endüstri gruplarını yansıtmaktadır.

Tablo 10. Türkiye-AB Dışı Ülkeler Hizmetler Ticareti Kapsamında, RCA3 Endekslerinin Yıllar İtibariyle Gelişimi (2010-2016)

| Kod | Hizmet Grubu | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|-----|--|------|------|------|------|------|------|------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | | | | | | | |
| SC | Taşımacılık | 0,43 | 0,41 | 0,46 | 0,48 | 0,50 | 0,53 | 0,64 |
| SD | Seyahat | 2,17 | 2,10 | 2,59 | 2,81 | 2,88 | 2,21 | 0,13 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | 0,27 | 0,30 | 0,26 | 0,36 | 0,24 | 0,24 | 0,29 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | 3,17 | 3,38 | 2,75 | 1,74 | 2,40 | 3,05 | 3,33 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | 0,14 | 0,09 | 0,17 | 0,23 | 0,13 | 0,14 | 0,13 |
| CS | Ticari hizmetler | 1,13 | 1,18 | 1,14 | 1,09 | 1,18 | 1,20 | 1,18 |

Tablo 11. Türkiye-AB Dışı Ülkeler Hizmetler Ticareti Kapsamında, RCAS3 Endekslerinin Yıllar İtibariyle Gelişimi (2010-2016)

| Kod | Hizmet Grubu | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|-----|--|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | | | | | | | |
| SC | Taşımacılık | -0,40 | -0,42 | -0,37 | -0,35 | -0,33 | -0,30 | -0,22 |
| SD | Seyahat | 0,37 | 0,36 | 0,44 | 0,48 | 0,48 | 0,38 | -0,77 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | -0,57 | -0,54 | -0,59 | -0,47 | -0,62 | -0,62 | -0,55 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | 0,52 | 0,54 | 0,47 | 0,27 | 0,41 | 0,51 | 0,54 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | -0,75 | -0,84 | -0,71 | -0,62 | -0,77 | -0,76 | -0,76 |
| CS | Ticari hizmetler | 0,06 | 0,08 | 0,07 | 0,04 | 0,08 | 0,09 | 0,08 |

Türkiye'nin AB dışı ülkeler ile hizmetler ticaretindeki rekabet gücünü, Türkiye'nin sadece AB dışı ülkelerle ticareti kapsamında yansıtan Tablo 11'deki bilgilere göre; 2010-2016 periyodunda seyahat hizmet grubunda, 2016 yılına kadar sürekli karşılaştırmalı üstünlük olduğu, ancak bunun 2016 yılında kaybedildiği görülmektedir. Taşımacılık hizmet grubunda 2010-2016 periyodunda hiç karşılaştırmalı üstünlük görülmemiştir. Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetlerinde 2010-2016 periyodunda sürekli karşılaştırmalı üstünlük gözlenmiştir. Genel olarak 'CS-Ticari hizmetler' kapsamında üstünlük görülmektedir ancak üstünlük derecesi nispeten çok da yüksek değildir.

Tablo 12 ve Tablo 13'de, Türkiye-AB dışı ülkeler hizmet ticaretini, Türkiye'nin Dünya ile ticareti kapsamında yansıtan RCA4 ve RCAS4 endeksleri görülmektedir. 2010-2016 periyodunda seyahat hizmet grubunda, 2016 yılına kadar sürekli karşılaştırmalı üstünlük olduğu, ancak bunun 2016 yılında kaybedildiği görülmektedir. Taşımacılık hizmet grubunda 2010-2016 periyodunda hiç karşılaştırmalı üstünlük görülmemiştir. Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetlerinde 2010-2016 periyodunda sürekli karşılaştırmalı üstünlük gözlenmiştir. Genel olarak 'CS-Ticari hizmetler' kapsamında üstünlük görülmektedir.

Tablo 12. Türkiye-AB Dışı Ülkeler Hizmetler Ticareti Kapsamında, RCA4 Endekslerinin Yıllar İtibariyle Gelişimi (2010-2016)

| Kod | Hizmet Grubu | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|-----|--|------|------|------|------|------|------|------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | | | | | | | |
| SC | Taşımacılık | 0,45 | 0,51 | 0,83 | 0,84 | 0,88 | 0,81 | 0,92 |
| SD | Seyahat | 2,28 | 2,61 | 3,52 | 3,71 | 3,89 | 3,36 | 0,18 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | 0,28 | 0,37 | 0,35 | 0,48 | 0,32 | 0,36 | 0,41 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | 3,33 | 4,19 | 3,74 | 2,30 | 3,27 | 4,65 | 4,76 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | 0,15 | 0,11 | 0,23 | 0,31 | 0,18 | 0,21 | 0,19 |
| CS | Ticari hizmetler | 1,19 | 1,46 | 1,55 | 1,43 | 1,60 | 1,83 | 1,69 |

Tablo 13. Türkiye-AB Dışı Ülkeler Hizmetler Ticareti Kapsamında, RCAS4 Endekslerinin Yıllar İtibariyle Gelişimi (2010-2016)

| Kod | Hizmet Grubu | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
|-----|--|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| S | EBOBS 2010 hizmetleri | | | | | | | |
| SC | Taşımacılık | -0,38 | -0,32 | -0,23 | -0,22 | -0,19 | -0,10 | -0,04 |
| SD | Seyahat | 0,39 | 0,45 | 0,56 | 0,58 | 0,59 | 0,54 | -0,69 |
| SF | Sigorta ve emeklilik hizmetleri | -0,56 | -0,46 | -0,48 | -0,35 | -0,51 | -0,47 | -0,42 |
| SK | Kişisel, kültür ve rekreasyon hizmetleri | 0,54 | 0,61 | 0,58 | 0,39 | 0,53 | 0,65 | 0,65 |
| SL | Resmi mal ve hizmetler | -0,74 | -0,80 | -0,63 | -0,53 | -0,70 | -0,66 | -0,68 |
| CS | Ticari hizmetler | 0,09 | 0,19 | 0,22 | 0,18 | 0,23 | 0,29 | 0,26 |

Türkiye-AB dışı ülkeler hizmet ticareti, Türkiye-AB dışı ülkeler ve Türkiye'nin dünya ile ticareti kapsamında ele alındığında büyük benzerlik taşımaktadır. Ancak Türkiye'nin AB-Dışı ülkelerle olan hizmet ticaretini, Türkiye'nin Dünya ile ticareti çerçevesinde yansıtan değerler, Türkiye-AB dışı ülkeler kapsamında hesaplandan daha yüksek değerler sunmuştur. Bunun anlamı Türkiye'nin AB dışı ülkelerle olan ticareti kapsamındaki üstünlüğünün, Dünya ile ticareti kapsamında hesaplanan üstünlük derecesinden düşük olduğudur.

Kısaca özetlemek gerekirse, 'taşımacılık', 'seyahat', 'kişisel, kültür ve rekreasyon' hizmet gruplarında karşılaştırmalı üstünlüğün görülebildiği ancak bu durumun AB ve AB Dışı ülkelerle olan ticaret bakımından farklılık gösterdiği anlaşılmaktadır. Bilhassa seyahat hizmetlerinde gerek AB gerekse AB-Dışı ülkeler bakımından karşılaştırmalı üstünlük söz konusudur. Ancak taşımacılık hizmetlerinde, Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile ticaretinde görülen üstünlük, Türkiye'nin Dünya ile ticareti bağlamında ortadan kalkarken, Türkiye-AB Dışı ülkeler ticaretinde hiç üstünlüğe sahip olmadığı görülmektedir.

Son olarak EİT ve Uyarlanmış karşılaştırmalı üstünlükler birlikte dikkate alındığında, Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile olan hizmetler ticaretinde; sadece 2016 yılında seyahat hizmetlerinde EİT gözlenmiş, diğer yıllarda EİT olmadığı tespit edilmiştir. Türkiye-AB Dışı ülkeler ticaretinde ise seyahat hizmetlerinde hiç EİT gözlenmemiştir. Tablo 11 ve Tablo 13'de görüldüğü gibi, seyahat hizmetlerinde ticaretin karşılaştırmalı üstünlükler kapsamında gerçekleştiği anlaşılmış ve yukardaki husus RCA analizi ile de doğrulanmış olmaktadır. İlave olarak, Türkiye'nin AB dışı ülkelerle ticaretinde seyahat

hizmetlerinde hiç EİT görülmemiştir. Sadece 2016 yılında oran 0,50'ye yaklaşmış (0,47) yani EİT'e doğru kaymıştır. Tablo 13'de RCAS4 analizinde görüldüğü gibi seyahat hizmetlerinde 2016 yılında karşılaştırmalı üstünlüğün kaybolduğu görüldüğünden, EİT'in arttığı, ölçek ekonomisi ve hizmet farklılaşması temelinde bir ticaret yapısına kayıldığı değerlendirilmiştir.

Taşımacılık hizmetlerinde de benzer bir eğilim gözlenmiştir. Türkiye'nin gerek AB28 gerekse AB dışı ülkeler ile olan 'Taşımacılık' hizmetleri ticaretinde yüksek EİT seviyesi gözlenmiş, ancak RCA analizlerinde bu grupta karşılaştırmalı üstünlük çıkmamıştır. Bu durum, Türkiye'nin taşımacılık hizmetlerinde ölçek ekonomisi ve hizmet farklılaşması temelinde bir ticaret yapısına sahip olduğu, ilgili ülkelerle rakip ekonomiler konumuna geldiği ve rekabet gücünü arttırdığı yorumuna imkan tanımıştır. Aksi olsaydı, işbölümü ve uzmanlaşma temelinde bir yapıya sahip olduğu yani ilgili ülkelerle tamamlayıcı ekonomi konumunda olduğu söylenebilecekti.

3. SONUÇ

Endüstri-içi ticaret, geleneksel karşılaştırmalı üstünlükler ve endüstriler arası ticarete göre, ilâve kazanımlar sağlamaktadır. Üretim ve hizmet sunumu bakımından ölçek ekonomilerine ulaşılması ile daha düşük maliyetli ve etkin üretim yapılabilen ve hizmet sunulabilen, daha geniş piyasalardan yararlanma imkânı sağlamakta, tüketiciler de farklılaşan ürün ve hizmetler nedeniyle, daha fazla ve geniş çeşitlilikte mal ve hizmetlere ulaşma imkânı bulmaktadır.

Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile ticaretinde; toplam hizmetler ticareti bakımından EİT oranı 0,73'ün altına hiç düşmemiştir. Bakım ve tamir hizmetleri, sigorta ve emeklilik, başkalarının sahip olduğu girdiler üzerine imalat hizmetleri ve diğer işletme hizmetlerinde oldukça yüksek EİT gözlenmiştir. İnşaat hizmetlerinde 2016 yılına kadar oldukça yüksek EİT gözlenirken, 2016 yılında keskin bir düşüş vardır (0,93'den 0,69'a düşmüştür). Seyahat hizmetlerinde, 2016 yılına dek EİT gözlenememiş, 2016 yılında ise biraz arttığı görülmüştür. AB-Dışı ülkelerle ticarete ise; toplam Hizmet sektörü bakımından EİT'in 0,50 sınırına yakın olduğu tespit edilmiştir. 2015 yılı hariç EİT oranı limit değerinin üstündedir. Alt hizmet gruplarına bakıldığında, 2016 yılında taşımacılıkta 0,78 gibi yüksek endeks değeri gözlenirken, 2010 yılından beri 0,75'in altına hiç düşmemiştir. Sigorta ve emeklilik hizmetlerinde 2010-2016 periyodunda her yıl yüksek oranda EİT gözlenirken, kişisel-kültür ve rekreasyon hizmetlerinde EİT tespit edilememiştir. Resmi mal ve hizmetler hizmet grubunda, 2012-2015 döneminde görülen EİT, 2016 yılında 0,49 endeks değeri ile sınırın altına düşmüştür ancak yine de EİT yapısı sergilediği söylenebilir. Türkiye'nin dışı açık hizmet sektörleri bakımından gerek AB28 gerekse AB28 dışı ülkelerle rakip ekonomiler durumunda olduğu ve ticaretin genelde ölçek ekonomileri ve hizmet farklılaşması temelinde gerçekleştiğini söylemek mümkündür.

RCA yani uyarlanmış karşılaştırmalı üstünlükler, ihracat performansı ve uzmanlaşma eğilimini yansıtmaları bakımından önemlidir. Türkiye'nin AB28 ve AB-dışı ülkelerle ticaretinde temel hizmet

grupları bakımından, ihracat performansı ve uzmanlaşmanın yönü, karşılaştırmalı üstünlüklerin ortaya çıkıp çıkmadığı önerilen dört farklı endeks ile ölçülmüştür. Uzmanlaşmanın arttığı hizmet grupları tespit edildiği gibi, zayıf performans görülen gruplar da tespit edilmiştir. Taşımacılık, seyahat, kişisel, kültür ve rekreasyon hizmet gruplarında, karşılaştırmalı üstünlüğün görülebildiği ancak bu durumun AB ve AB Dışı ülkelerle olan ticaret bakımından farklılık gösterdiği anlaşılmıştır. Seyahat hizmetlerinde hem AB hem de AB-Dışı ülkeler bakımından karşılaştırmalı üstünlük söz konusudur. Ancak taşımacılık hizmetlerinde, Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile ticaretinde görülen üstünlük, Türkiye'nin Dünya ile ticareti bağlamında ortadan kalkarken, Türkiye-AB Dışı ülkeler ticaretinde üstünlüğe sahip olmadığı görülmektedir.

EİT ve Uyarlanmış karşılaştırmalı üstünlükler birlikte dikkate alındığında, Türkiye'nin AB28 ülkeleri ile olan hizmetler ticaretinde; sadece 2016 yılında seyahat hizmetlerinde EİT gözlenmiş, diğer yıllarda EİT olmadığı tespit edilmiştir. Türkiye-AB Dışı ülkeler ticaretinde ise seyahat hizmetlerinde hiç EİT gözlenmemiştir. Seyahat hizmetlerinde ticaretin karşılaştırmalı üstünlükler kapsamında gerçekleştiği anlaşılmış ve RCA analizleri de bu durumu doğrulamıştır. Türkiye'nin AB dışı ülkelerle ticaretinde seyahat hizmetlerinde EİT düşüktür. Sadece 2016 yılında oran 0,50'ye yaklaşmış (0,47) yani EİT'e doğru kaymıştır. RCA analizlerinde, seyahat hizmetlerinde 2016 yılı itibarıyla karşılaştırmalı üstünlüğün kaybolduğu tespit edildiğinden, EİT'in arttığı, ölçek ekonomisi ve hizmet farklılaşması temelinde bir ticaret yapısına kayıldığı değerlendirilmiştir.

KAYNAKLAR

- Bela Balassa (1965), "Trade Liberalisation and 'Revealed' Comparative Advantage", The Manchester School Journal, 33(2): 99-204
- Balassa, Bela (1966). "Tariff Reductions and Trade in Manufactures Among The Industrial Countries", American Economic Review, 56: 466-473. (içinde, Herbert G. Grubel and P.J. Lloyd(Eds.), Intra-Industry Trade. Edward Elgar Publishing, Cheltenham: 2003, 28-35)
- Baldone, Salvatore, Fabio Sdogati & Lucia Tajoli (2007). "On Some Effects of International Fragmentation of Production on Comparative Advantages", The World Economy, 30 (11): 1726-1769
- Chou, Chien-Fu & Oz Shy (1991). "Intra-Industry Trade and the Variety of Home Products", The Canadian Journal of Economics, 24(2): 405-416
- Clark, Don P., W.Charles Sawyer & Richard L. Sprinkle (2005). "Revealed Comparative Advantage Indexes for Regions of the United States", Global Economy Journal, 5(1).
- Fertő, Imre & L.J. Hubbard (2003). "Revealed Comparative Advantage and Competitiveness in Hungarian Agri-Food Sectors", World Economy, 26(2): 247-259

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Greenaway, David & Chris Milner (1986). *The Economics of Intra-Industry Trade*, Basil Blackwell, Oxford
- Grubel, H. & P.J. Lloyd (1971). "The Empirical Measurement of Intra-Industry Trade", *Economic Record*, 47: 494-517
- Grubel, Herbert G. & P.J. Lloyd (1975). *Intra-Industry Trade, Theory and Measurement of International Trade in Differentiated Products*, Halsted Press-John Wiley and Sons Ltd, New York
- Grubel, Herbert G. & P.J. Lloyd(Eds.) (2003). *Intra-Industry Trade, The International Library of Critical Writings in Economics Series*, Edward Elgar Publishing, Cheltenham
- Hoen, Alex R. & Oosterhaven, Jan (2006). "On the Measurement of Comparative Advantage", *Annals of Regional Science*, 40(3): 677-691
- Jackman, Mahalia, Troy Lorde, Shane Lowe & Antonio Alleyne (2011). "Evaluating Tourism Competitiveness of Small Island Developing States: A Revealed Comparative Advantage Approach", *Anatolia - An International Journal of Tourism and Hospitality Research*, 22(3): 350-360
- Javeria Maryam, Umer Jeelanie Banday & Ashok Mittal (2018). "Trade Intensity and Revealed Comparative Advantage: an Analysis of Intra-BRICS Trade", *International Journal of Emerging Markets*, 13(5): 1182-1195
- Iapadre, Lelio P. (2001). "Measuring International Specialisation", *International Advances in Economic Research*, 7(2): 173-183
- Kol, Jakob & L.M. Mennes (1986). "Intra-Industry Specialization: Some Observations on Concepts and Measurement", *Journal of International Economics*, 21: 173-181
- Küçükahmetoğlu, Osman (2002). "Endüstri-içi Ticaret ve Türkiye", *İktisat, İşletme ve Finans*, 17(90): 34-50
- Levchenko, Andrei A., Jing Zhang (2016), "The Evolution Of Comparative Advantage: Measurement and Welfare Implications", *Journal of Monetary Economics*, 78: 96-111
- Mahani Zainal Abidin & Wai Heng Loke (2008). "Revealed Comparative Advantage of Malaysian Exports: The Case for Changing Export Composition", *Asian Economic Papers*, 7(3): 130-147
- Miteva-Kacarski, Emilija (2018). "Revealed Comparative Advantage in Trade Between the Republic of Macedonia and CEFTA 2006", *Economic Review, Journal of Economics and Business*, 16 (1): 59-70. ISSN 1512-8962

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

OECD (2018). Trade in services (indicator). doi: 10.1787/3796b5f0-en (Accessed on 22 November 2018)

Peterson, John (1988). "Export Shares and Revealed Comparative Advantage". A Study of International Travel", Applied Economics. 20: 351-365

Ratnayake, Ravindra (1990). "Patterns and Determinants of Export Specialisation in Australian Manufacturing", Australian Journal of Management, 15(2): 339-361

Rodas-Martini, Pablo (1998). "Intra-Industry Trade and Revealed Comparative Advantage in the Central American Common Market", World Development, 26(2): 337-344

Seyoum, Belay (2007). "Revealed Comparative Advantage and Competitiveness in Services: A Study With Special Emphasis on Developing Countries", Journal of Economic Studies, 34(5): 376-388

Sharma, Kishor (2000). "Pattern and Determinants of Intra-Industry Trade in Australian Manufacturing", The Australian Economic Review, 33(3): 245-255

Startienė, Gražina & Rita Remeikienė (2014). "Evaluation of Revealed Comparative Advantage of Lithuanian Industry in global Markets", Procedia - Social and Behavioral Sciences, 110: 428-438

TCMB (2018). Elektronik Veri Dağıtım Sistemi.

WTO (2015). "Services Trade".
https://www.wto.org/english/thewto_e/20y_e/services_brochure2015_e.pdf (erişim: 11/11/2018)

WTO (2017). World Trade Statistical Review 2017.
https://www.wto.org/english/res_e/statis_e/wts2017_e/wts2017_e.pdf (erişim: 24/11/2018)

ALT-ÖRNEKLEME VE ÜST-ÖRNEKLEME YÖNTEMLERİ İLE ÇALIŞANLARIN İŞTEN AYRILMA TAHMİNİ

Dr. Öğr. Üyesi Ufuk ÇELİK*

ÖZET

Bu çalışmada veri madenciliği teknikleri ile çalışanların işten ayrılma durumlarının Aşırı Gradyan Güçlendirme algoritması ile tahmini yapılmıştır. Tahmin için IBM şirketi tarafından sunulan 1470 adet çalışanın 35 farklı özneliği içeren verileri kullanılmıştır. Verilerin sınıflamasında “İşten Ayrılma” öz niteliği dengeli bir şekilde dağılım göstermediği için alt ve üst örnekleme yöntemleri ile veriler optimize edilerek %90'nın üzerinde doğruluk oranı elde edilmiştir. Çalışmada işten ayrılmayı etkileyen faktörlerde incelenmiş ve aşırı çalışma, yaş, aylık gelir, görev tanımı gibi kavramların en etkili öznelikler olduğu anlaşılmıştır.

Anahtar Kelimeler: veri madenciliği, iş analitiği, işten ayrılma, veri örnekleme

JEL Kodları: E37, D70, J63, C80

EMPLOYEE TURNOVER PREDICTION WITH DOWN-SAMPLING AND UP-SAMPLING

METHODS

ABSTRACT

In this study, employee turnover prediction was estimated with Extreme Gradient Boost algorithm by using data mining techniques. The data of 1470 employees including 35 different attributes, which is provided by IBM Company were used. Data were optimized with down sampling and up sampling because of the unbalanced class attribute named attrition and 90% of accuracy result were obtained after that. In the study, the factors affecting the turnover were examined and it was understood that the concepts such as overwork, age, monthly income, job definition were the most effective attributes.

Keywords: Data Mining, Business Analytics, Employee Turnover, Data Sampling

JEL Codes: E37, D70, J63, C80

* Bandırma Onyedli Eylül Üniversitesi, Ö.S. Uygulamalı Bilimler Fakültesi, Yönetim Bilişim Sistemleri Bölümü
ucelik@bandirma.edu.tr

1. GİRİŞ

Çalışanların işyerlerine bağlılık durumları incelendiğinde temelinde örgütsel adalet algısının bulunduğu görülmektedir. Bu algıyı etkileyen faktörlerin en önemlileri arasında ise fayda maliyet kapsamında çalışanların kendilerini örgütle özleştirmesi anlamında emeğin karşılığı olan ücret, çalışma saatleri arasındaki ilişki gelmektedir (Black & Porter, 2000). Bu algıyı doğru yönetebilmek için başlangıçta insan kaynaklarının uygun personeli bulması daha sonrasında ise uygun personelin de doğru bir şekilde yönetilmesi gereklidir (Altıntaş, 2006; Mobley, 1977, 1982). Bu bağlamda şirket çalışanlarının bir işyerini terk etme durumları iyi bir şekilde gözlemlenmeli ve gerekli düzeltmeler olası bir personel kaybından önce yapılmalıdır.

Bu çalışmada R programlama dilinde alt ve üst örnekleme yöntemiyle veri dengesi sağlanarak Aşırı Gradyan Güçlendirme “Extreme Gradient Boost” (XGBoost) algoritması ile çalışan kaybı analizi yapılmış ve sonuçlar incelenmiştir.

2. VERİ

Çalışmada kullanılan veriler IBM Şirketinin Watson Analytics sisteminde tanıtılan çalışanların işten ayrılması için hazırlanan örnek veritabanından alınmıştır (Stacker, 2015). 1470 adet çalışanın 35 farklı özniteliği içeren veri seti “işten ayrılma” özniteliği dengeli bir dağılım göstermediği için alt ve üst örnekleme yöntemleri ile veriler optimize edilmiştir.

3. YÖNTEM

Bu çalışmada yöntem olarak XGBoost algoritması kullanılmıştır. R-CRAN paketi içinde yer alan bu algoritma aslında gradyan güçlendirmeli karar ağaçları (gradient boosting decision tree) algoritmasının genişletilmiş bir sürümüdür (Chen, He, & Benesty, 2015). Degrade artırma, önceki modellerin kalıntılarını veya hatalarını tahmin eden ve daha sonra nihai tahmin yapmak için bir araya getirilen yeni modellerin oluşturulduğu bir yaklaşımdır. Yeni modeller eklenirken kaybı en aza indirmek için bir degrade azaltma veya artırma algoritması kullandığı için gradyan güçlendirme denir (Brownlee, 2016).

Çalışma için elde edilen verilerde sınıflama özniteliği olan işten ayrılma dengeli bir dağılım göstermediği için (237 kişi Evet, 1233 kişi Hayır) veriler alt ve üst örnekleme yöntemi olan SMOTE (synthetic minority over-sampling technique) “Sentetik Azınlık Aşırı Örnekleme Tekniği” ile dengeli bir hale getirilmiştir (Chawla, Bowyer, Hall, & Kegelmeyer, 2002). Azınlık sınıfından, örnekleme yapılacak özniteliği için en yakın komşularına göre veri kümesinden bir örnek ve bu örnek ile en yakın komşularından birisi arasında bir vektör alınır. Bu vektör 0 ile 1 arasında rastgele bir sayı ile çarpılarak mevcut veri noktasına eklenir. Böylece yakın komşularına göre türetilen yapay bir veri sağlanmış olur.

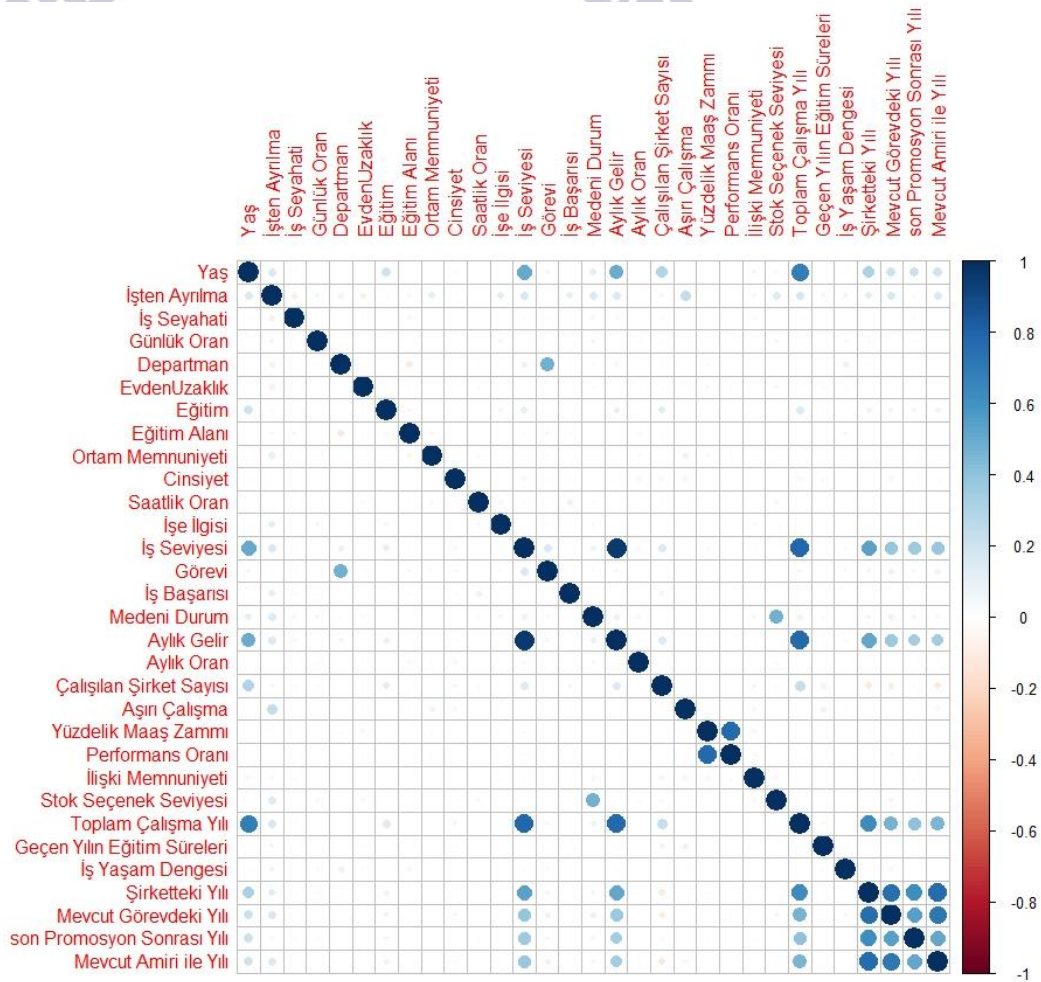
Analizler için kullanılan R programlama dili açık kaynak kodlu betik çalışan bir dildir (Ihaka & Gentleman, 1996; “The R Project for Statistical Computing”, y.y.). Bu dil kayıtları vektör, liste, veri

çerçevesi gibi özel veri yapıları sayesinde ön tanımlı fonksiyonlar ile veriye bellek üzerinden doğrudan erişmek yerine sembol ve referanslarla kontrol eder (Özdemir vd., 2018). Fonksiyonlar R web sitesi üzerinde CRAN olarak adlandırılan paketler içindedir (“The Comprehensive R Archive Network”, y.y.).

4. BULGULAR

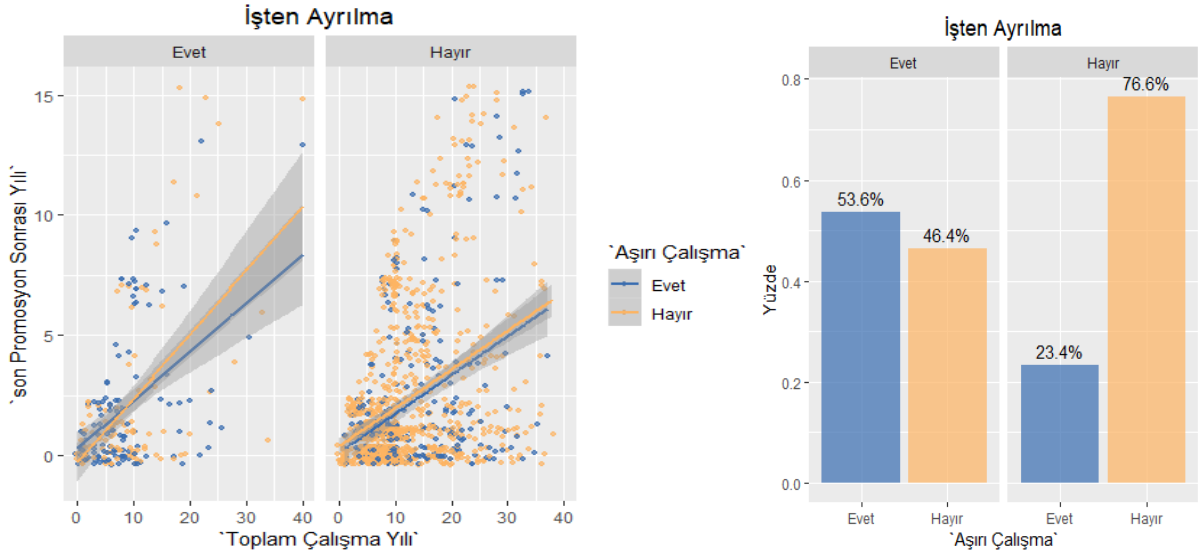
Veri madenciliğinin temel bir adımı olan veri temizliği ve bütünlüğünün sağlanması ile başlayan analizde XGBoost algoritması için sayısal veriler kategorize edilir. Veri setinde kayıp veriler bulunmamaktadır. “Çalışan Numarası” ile “Çalışan Sayısı” gerekli olmadığı için ve “Standart Saatler” ile “18 Yaş Üstü” verileri tüm kayıtlar için aynı olması sebebiyle veri setinden kaldırılmıştır.

Şekil 1. Korelasyon Grafiği



Şekil 1 ile gösterilen grafiğe göre tahminleyici niteliklerin birbirleri ile korelasyonunun zayıf olduğu anlaşılmaktadır. “Aylık Gelir”, “Şirketteki Yılı”, “Mevcut Görevdeki Yılı”, “Son Promosyon Sonrası Yılı” ve “Mevcut Amiri ile Çalışma Yılı” niteliklerinin arasında negatif korelasyonu vardır.

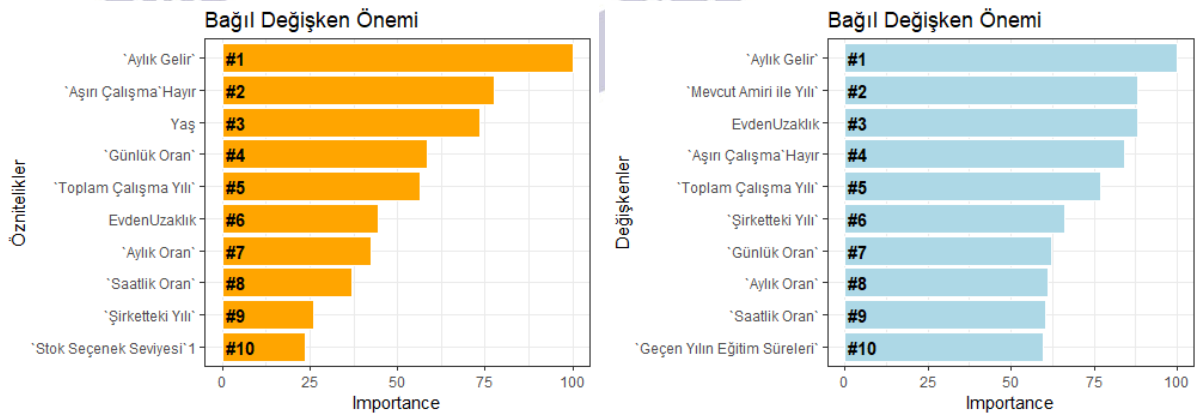
Şekil 2. Çalışma süreleri ve işten ayrılma arasındaki ilişki grafikleri



“İşten Ayrılma” niteliğinin çalışanların çalışma süreleri ile arasındaki ilişki Şekil 2 ile gösterilmiştir. İşten ayrılanların %53.6’sı aşırı çalışma göstermiştir.

XGBoost algoritmasına göre yapılan analizde Şekil 3’te turuncu ile gösterilen grafikte bağıl değişkenler önem sırasına göre dizildiğinde “Aylık Gelir”, “Aşırı Çalışma (hayır)”, “Yaş”, “Günlük Oran”, “Toplam Çalışma Yılı” ilk 5 sırada gelen nitelikler olmaktadır. Veriler SMOTE tekniği ile dengeli bir hale getirildikten sonra ise Şekil 3’te mavi ile gösterilen grafikte bağıl değişkenlerin sırasıyla “Aylık Gelir”, “Mevcut Amiri ile Çalışma Yılı”, “Evden Uzaklık”, “Aşırı Çalışma (hayır)” ve “Toplam Çalışma Yılı” ilk 5 sırada yer almaktadır.

Şekil 3. Bağıl Değişken Önemi



Tablo 6. Analiz Sonuçları

| SMOTE öncesi | | | SMOTE sonrası | | |
|---------------|--------|-------|---------------|--------|-------|
| | Evet | Hayır | | Evet | Hayır |
| İşten Ayrılma | 1233 | 237 | İşten Ayrılma | 711 | 474 |
| Tahmin | Evet | Hayır | Tahmin | Evet | Hayır |
| Evet | 9 | 3 | Evet | 130 | 15 |
| Hayır | 40 | 242 | Hayır | 9 | 83 |
| Doğruluk | 0.8537 | | Doğruluk | 0.8987 | |

5. SONUÇ VE TARTIŞMA

Elde edilen sonuçlara göre XGBoost algoritması SMOTE öncesi ve sonrası karşılaştırma matrisi tablosu Tablo 1 ile gösterilmiştir. Verilerin dengeli bir hale getirilmesi doğruluk oranında %85.37'den %89.87'e artış sağlamıştır.

Verilerin alt ve üst örnekleme yöntemi ile dengelenmesi elbette bağlı değişkenlerin sıralamasında bir değişiklik yapmıştır. Burada “Aylık Gelir” ve “Toplam Çalışma Yılı” aynı sırada kalırken ikinci, üçüncü ve dördüncü nitelikler değişmiştir.

Şekil 2 ile gösterilen ilişkiye göre toplam çalışma yılı ile son promosyon sonrası yılı verileri işten ayrılma ve aşırı çalışma verilerine göre gruplandırılmıştır. Bu veriler arasındaki yüksek korelasyon değerlerine göre bu çalışanların şirkette gerçekten ilerleyemediklerini söyleyebiliriz. Aşırı çalışma durumuna göre işten ayrılmaları incelediğimizde insanların çok çalışsa da terfi edemedikleri için işten ayrıldığı şeklinde bir örüntü görülmektedir.

REFERANSLAR

Altıntaş, F. Ç. (2006). Bireysel Değerlerin Örgütsel Adalet Ve Sonuçları İlişkisinde Yönlendirici Etkisi: Akademik Personel Üzerinde Bir Analiz. Dokuz Eylül Üniversitesi İşletme Fakültesi Dergisi, 7(2), 19–40. Tarihinde adresinden erişildi

<http://acikerisim.deu.edu.tr/xmlui/handle/12345/2349?show=full>

Black, J. S., & Porter, L. W. (2000). Management: Meeting New Challenges. Prentice Hall. Tarihinde adresinden erişildi <https://books.google.com.tr/books?id=J0KXQgAACAAJ>

Brownlee, J. (2016). A Gentle Introduction to XGBoost for Applied Machine Learning. Tarihinde 01 Kasım 2018, adresinden erişildi <https://machinelearningmastery.com/gentle-introduction-xgboost-applied-machine-learning/>

Chawla, N. V, Bowyer, K. W., Hall, L. O., & Kegelmeyer, W. P. (2002). SMOTE: synthetic minority over-sampling technique. Journal of artificial intelligence research, 16, 321–357.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Chen, T., He, T., & Benesty, M. (2015). Xgboost: extreme gradient boosting. R package version 0.4-2, 1-4.

Ihaka, R., & Gentleman, R. (1996). R: a language for data analysis and graphics. *Journal of Computational and Graphical Statistics*, 5(3), 299-314.

Mobley, W. H. (1977). Intermediate linkages in the relationship between job satisfaction and employee turnover. *Journal of Applied Psychology*, 62(2), 237-240.
<https://doi.org/10.1037/0021-9010.62.2.237>

Mobley, W. H. (1982). *Employee Turnover, Causes, Consequences, and Control*. Addison-Wesley. Tarihinde adresinden erişildi <https://books.google.com.tr/books?id=0BNtQgAACAAJ>

Özdemir, A. F., Yıldıztepe, E., Binar Dokuz, M., Üniversitesi, E., Fakültesi, F.-E., & Bölümü, İ. (2018). *İstatistiksel Yazılım Geliştirme Ortamı: R*.

Stacker, M. (2015). *Sample Data: HR Employee Attrition and Performance*. Tarihinde 01 Kasım 2018, adresinden erişildi <https://www.ibm.com/communities/analytics/watson-analytics-blog/hr-employee-attrition/>

The Comprehensive R Archive Network. (y.y.). Tarihinde 01 Kasım 2018, adresinden erişildi <https://cran.r-project.org/>

The R Project for Statistical Computing. (y.y.). Tarihinde 01 Kasım 2018, adresinden erişildi <https://www.r-project.org>

**SİNEMADA YÜKSELEN DEĞER MARKA YERLEŞTİRME: AİLE ARASINDA
FİLMİ'NİN MARKA YERLEŞTİRME AÇISINDAN İNCELENMESİ**

Doç. Dr. Şükran Güzin ILICAK AYDINALP*

Dr. Öğr. Üyesi Sinem TUNA**

ÖZET

Kitle iletişim araçlarında yoğun reklam bombardımanı altında kalarak boğulan tüketiciler, artık tek tuşla görüntüyü ileriye sararak reklamlardan kurtulma yoluna gitmektedir. Reklam ve halkla ilişkiler faaliyetlerinin bazı özelliklerini taşıdığı için "hibrit mesaj" olarak nitelendirilen marka yerleştirme sinema filmleri, televizyon dizileri ve programları, internet dizileri, viral videolar, forumlar, bloglar, animasyonlar, müzikaller, video klipler, video oyunları, romanlar, karikatürler, hikayeler, öyküler vb. bir çok alanda kullanılmaktadır. Büyük perdeye yansıyan duyguların insanları etkileme gücünü fark eden markalar, sinemada marka yerleştirmeden özellikle faydalanmaktadır. Bu noktada marka yerleştirme, marka ile filmin yapımcısı arasındaki karşılıklı, yararlı ilişki anlamına gelmektedir. Kültür ve Turizm Bakanlığı Sinema Genel Müdürlüğü verilerine göre 2018 yılı en çok seyredilen ilk 5 film arasında 4. olarak yer alan Aile Arasında filmi 64.556.327,85 yıl'lik hasılatı ile ülkemizde sinema endüstrisinin geldiği parasal noktayı da özetlemektedir. Reklam verenlerin ulaştıkları kişi sayısı ve etkinliği bakımında iştahını kabartan sinema filmleri, yapımcıları da marka yerleştirme tekniğine finansal açıdan gelirlerini arttırmak için kucak açmalarına neden olmaktadır. Bu çalışmada sinemada marka yerleştirmenin önemi ve değeri irdelenecektir. Şu ana kadar geldiği boyut ve markaların bu tekniği kullanmadaki avantajları ve dezavantajları tartışılacaktır. Ayrıca senaryosu Gülse Birsal tarafından yazılan Ozan Açıktan'ın yönetmenliğinde çekilen 31 hafta boyunca gösterimde kalarak yaklaşık 5.288.987 seyirciye ulaşan Aile Arasında filmi, marka yerleştirme açısından incelenecektir. Marka yerleştirme ile ilgili çok çeşitli sınıflandırmalar bulunmaktadır. Bu çalışmada Shapiro tarafından, ürünün kurgusal örüntüde kullanım derecesine göre yapılmış sınıflandırması kullanılarak Aile Arasında filminin marka yerleştirme çözümlemesi yapılacaktır.

Anahtar Kelimeler: *Marka Yerleştirme, Sinema, Marka, Halkla İlişkiler*

JEL Kodları: *M30, M31, M39*

* İstanbul Gelişim Üniversitesi, İktisadi, İdari ve Sosyal Bilimler Fakültesi, Halkla İlişkiler ve Tanıtım Bölümü, sgilicak@gelisim.edu.tr

** İstanbul Gelişim Üniversitesi, İktisadi, İdari ve Sosyal Bilimler Fakültesi, Radyo, Televizyon ve Sinema Bölümü, stuna@gelisim.edu.tr

BRAND PLACEMENT AS A RISING VALUE IN CINEMA: ANALYSIS OF THE "AİLE ARASINDA" MOVIE IN THE CONTEXT OF BRAND PLACEMENT

ABSTRACT

Consumers who are drowned in mass media under intense advertising bombardment are now free to run away from these ads by fast-forwarding with a single keystroke. Brand placement is characterized as "hybrid message" because it carries some of the characteristics of both advertising and public relations. It is used in numerous areas such as cinema movies, television series, television programs, internet series, forums, blogs, musicals, songs, video clips, video games, novels, caricatures, stories, narratives and so forth. Brands that recognize perceive the influential power of emotions reflected on bir screen, benefit from brand placement especially in cinema. At this point, brand placement means a mutually beneficial relationship between the brand and the producer of the film. According to the data of Ministry of Culture and Tourism General Directorate of Cinema, "Aile Arasında" movie placed forth in 2018's list of the first 5 films that is watched and the film also summarizes the monetary point of the cinema industry in our country with 64.556.327.85 YTL box office. In terms of the number of people reached and their impacts cinema films encourages a financial purpose usage for producers. In this study, the importance and value of brand placement in cinema will be discussed. In the context of usage advantages and disadvantages of the brand placement will be discussed and the size of brand placement will be described which has been recently reached. In addition, the film which written by Gülse Birsal, directed by Ozan Açıktan and showed over 31 weeks will be analyzed on the context of the brand placement. There are several classifications related to brand placement. In this study, Shapiro's approach will based which regards the usage of brand in film's. Accordingly, brand placement analysis of the film will be made.

Keywords: Brand Placement, Cinema, Product, Public Relations

JEL Codes: M30, M31, M39

1.GİRİŞ

Adorno ve Horkheimer modernizmin kültürü aynılaştırıcı etkisinin olduğunu ifade ederek günümüzde tek boyutlu bir toplumun yaratıldığına dikkat çekerler. Modern hayatın birey ve kültür üzerinde olan etkisini kültür endüstrisi kavramı ile belirten Adorno ve Horkheimer, özellikle tüketiminde bu endüstriyi beslediğini savunurlar. Kültür endüstrisinin hükümdarlığını ilan ettiği 21. yüzyılda tüketimin tetikleyicisi ise reklamlar olarak karşımıza çıkmaktadır. Her türlü kanaldan alınan

reklam bombardımanı, reklam kalabalığına yol açmakta bu yoğun ve rahatsız edici süreç ise tüketicilerin reklam iletilerine karşı ilgisiz ve duyarsızlaşmasıyla sonuçlanmaktadır.

Reklamların tüketiciler tarafından yeterince inandırıcı bulunmadıkları ve ayrıca tüketicilerin önemli bir kısmının reklamları sıkıcı, bunaltıcı, yanıltıcı ve dikkat dağıtıcı bularak tercihlerini izlememe yönünde kullandıkları (Snatchfold, 2005,) tespiti ise oldukça düşündürücüdür.

John Wanamaker'ın uzun yıllar önce yaptığı "Reklam bütçemin yarısı boşa gitti. Ancak sorun şu ki, bunun hangi yarısı olduğunu bilmiyorum" açıklaması (Lindstrom, 2009:28) reklamcılarında bu geleneksel süreçten oldukça etkilendiğini göstermektedir. Markalar ise artık birinci ağızdan tüketiciye direkt satın alma mesajı vermeden bilinçaltına yönelik çalışmalar yapma yoluna gitmeye başlamışlardır. Farklı kanalları kullanarak tüketiciyle buluşmaya çalışan markalar, oyuncuların kullandıkları ürünler ya da konuşma içinde geçen metinlere dahil olarak tüketici algısında hatırlanmak ve bir bağ kurmak istemektedir. Bu süreçte ise marka konumlandırma, markalar için artık vazgeçilmez bir yöntem dönüşmüştür. Literatüre bakıldığında 'marka yerleştirme' yaygın olarak da 'ürün yerleştirme' olarak ifade edilen ifadeler ortaya çıkmaktadır. Bu konuyla ilgili ise farklı görüşler mevcuttur.

Karrh (1998) kullanımda olan "ürün yerleştirme- product placement" terimi yerine "brand placement- marka yerleştirme" teriminin kullanılmasının daha uygun olacağını belirtmektedir. Yazar, bu önerisinin dayanağı olarak da, filmlere, dizilere ya da oyunlara dahil edilerek bilinirliğin artırılması ve hatırlatılması amacı güdülenlerin ürünler değil, markalar olduğunu öne sürer. Odabaşı ve Oyman (2002: 377) da ürün yerleştirme adlandırmasına karşı çıkararak yerleştirilenin bir marka olduğunu savunmakta ve marka yerleştirme adlandırmasını tercih etmektedir.

Ürün ve marka arasındaki, temel fark ise şöyledir. Ürün üretilen bir şeydir ve aynı ürün farklı birçok işletmede de üretilmektedir. Oysaki marka ürünle birlikte vaad edilen tüm değerlere atıfta bulunmaktadır. Marka vaadinde, markanın değeri, garantisi, kalitesi özelliği, duygusal ve manevi bağı vb.dır. Yani bir tv programı içine yerleştirilen arabayı seyirciler salt ürün olarak görmeyip, Porche olarak 'hız, tutku, serüven' olarak görmekte yani aslında orada marka olarak algılamaktadır. Bu yüzden bu çalışmada ürünü markadan bağımsız olarak düşünmediğimiz için marka yerleştirme ifadesi kullanılacaktır.

2. MARKA YERLEŞTİRMENİN TANIMI, UYGULANIŞI VE TARİHSEL GELİŞİMİ

Marka yerleştirme, görsel ve işitsel basın yayın araçları ile ya da sinema sektöründe potansiyel görülen projelerde, ürettiği ürünün reklamını herhangi bir öykünün parçası gibi yerleştirmeyi ifade eden bir pazarlama çalışmasıdır. Başka bir ifadeyle; çeşitli iletişim araçlarına, markalı ürünlerin ücreti karşılığında doğal akış içinde bilinç oluşturma faaliyeti olarak ifade edilmektedir (Karrh, James A,1998:33). Nelson (2002: 85) ise marka yerleştirmeyi reklamcının iletişim mesajını çeşitli eğlence ve

bilgi verici kitle iletişim araçları içine olay örgüsünün doğal parçası gibi yerleştirmesi olarak tanımlamaktadır.

Çeşitli eğlence ve bilgi verici kitle iletişim araçları ifadesini açarsak bu ifade içine sinema filmleri, televizyon dizileri ve programları, internet dizileri, viral videolar, forumlar, bloglar, animasyonlar, müzikaller, video klipler, video oyunları, romanlar, karikatürler, hikayeler, öyküler vb. bir çok alan dahil olmaktadır. Günümüzde bu araçların her birinde ücret karşılığında bilinçli olarak marka yerleştirme yapılmaktadır.

Ginosar ve Levi-Faur (2010: 5) reklamcılar marka yerleştirmeye yönelen şeyi 4 başlıkta incelemiştir. Bunlardan ilki izleyicilerin çok çeşitli televizyon kanalına ulaşmasını sağlayan dijital devrimdir. Bu durum çeşitli televizyon izleyicilerine aynı spot reklamlarla ulaşmayı hem daha zor hem de daha kullanışsız hale getirmektedir. İkincisi yeni nesil kayıt cihazlarının izleyicilerinin spot reklamlarını atlamasına imkân tanınmasıdır. Üçüncü olarak internet, reklamcılar dikkatini çeken ve reklamcılık bütçesinde büyüyen paya sahip olan bir araç olarak karşımıza çıkmaktadır. Dördüncü olarak marka yerleştirme reklam yapımının daha kolay ve az maliyetli olabileceğini kanıtlamaktadır.

Marka yerleştirmenin en yoğun olarak kullanıldığı alanların başında ise Lumière kardeşlerin sinematografi cihazını geliştirmesiyle hayat bulan 7.sanat olarak adlandırılan sinema gelmektedir. Sinema filmleri hayal ve gerçek arasında kurdukları bağ ile, oyuncu kadrosu ve senaryosu ile farklı iç ve dış mekanların varlığı ve müzik, efekt teknikleri ile adete seyirci üzerinde hipnoz etkisi yaratmaktadır. Bu süreçte sinema büyümesine kapılan izleyicinin sinema salonundan dışarı çıkmaması ve tüm ilgisini filme vermesi, tv seyretme ortamındaki her türlü çekici unsurun salon ortamından kaldırılması, izleyicinin izleme dışında başka bir şeye yoğunlaşmaması gibi özellikler film yapımçıların dikkatini çekmiştir. Filmlerde marka yerleştirme, kendine özgü karakteristikleriyle geleneksel reklam yöntemlerinden ayrılmaktadır.

Günümüzde artık marka yerleştirme bir endüstri haline gelmiştir. Medya planlamacıları, marka yerleştirme uzmanları, marka yerleştirme ajansları, yapım şirketleri ve reklam ajanslarından oluşan büyük bir ekip bu endüstrinin önemli parçalarıdır. Reklam verenler bazen daha film fikir aşamasındayken marka yerleştirmek için yapımçı şirketlerin peşine düşerler. Çoğu zamanda marka yerleştirmede yapım şirketi devreye girmektedir. Sinema filmi daha fikir aşamasındayken ya da çekilirken de olabilir yapım şirketi reklam verenlerle irtibata geçer. Barter ya da belli bir ücret karşılığında reklamı yapılması istenen markanın film içinde uygun yere yerleştirilmesi sağlanır.

Hollywood sinemasında filmde yar alan prodüktör, yönetmen, yazar ve star oyuncular gibi üst kademenin de filmle ilgili söz sahibi olmaları dolayısıyla potansiyel marka yerleştirmeleri konusunda veto hakları vardır. (Karrh, a.g.m., pp. 35-36.) Tıgılı'ya (2004: 35) göre markalı ürün eğer doğru sahnede yerleştirilmişse gerçeklik duygusu yaratır ve karakterin rolü içinde kullanması izleyicide gerçekte de

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

kullandığı izlenimi uyandırır. Aynı zamanda gerçek markaların yerleştirilmesi izleyicinin filmle özdeşleşmesini kolaylaştırmaktadır.

Filmlerde yerleştirilen ilk ürün, Sun Light sabunlarıdır. Bu marka, 1896 yılında Lumière kardeşlerin çektiği kısa metrajlı bir filme yerleştirilmiştir (Reijmersdal vd., 2010: 279). Çoğu kaynakta ise filmlerde marka yerleştirme 1932 yapımı “Yaralı Yüz” filmine 250 bin dolar veren White Owl Cigars işletmesinin talebi ile başrol oyuncusu Poul Muni'nin film boyunca bu markanın sigarasını içmesidir (Sen, 2010: 17).

20. yüzyıl başlarından itibaren izleyicide sigara içme isteği uyandırılması ve sigara farkındalığı yaratmak amacıyla sigara markaları film yapımcılarının peşine düşmüştür. Film şirketleri ise her geçen gün artan yapım masraflarını düşürebilmek için bu uygulamayı kabul etmişlerdir. Mc Kechnie ve Zhou (2003: 349) Amerikan sigara markalarının film yıldızlarına ve bunun yanında sporculara da markalarını temsil etmeleri için para ödediklerini belirtmektedir.

Marka yerleştirmeye bir diğer örnek, 1934 yılında gösterime giren Bir Gecede Oldu (It Happened One Night) filmidir. Bu filmde oynayan Clark Gable'in üzerini değiştirirken gömleğinin altına atlet giymemesi atlet satışlarında düşme yaşatmıştır (Sen, 2010: 17). Arslan (2011: 17) marka yerleştirmenin güçlü etkisinin fark edilmesi üzerine 1939'da Metro-Goldwyn-Mayer'in, bir yerleştirme bölümü açan ilk film stüdyosu olarak tarihe geçtiğini ifade etmektedir.

1950 yılında 'Destination Moon' adlı filmde dört uzay astronotu Coca-Cola içerken ve Lee markalı jean giyerken gösterilmiştir (DeLorme ve Reid, 1999: 71).

Kimilerine göre de 1951 yapımı olan “African Queen” adlı film ilk marka yerleştirilmenin profesyonelce yapıldığı filmidir. Filmin bir sahnesinde başrol oyuncularından Katherine Hepburn, Humphrey Bogart'a bir şişe Gordon's Dry Cin fırlatmaktadır. Bu açıdan marka yerleştirmenin nasıl başladığı veya ilk hangi yapımda kullanıldığına dair görüşler sürekli farklılık göstermektedir.

1970'li yıllara kadar marka yerleştirme çalışmaları barter (takas) şeklinde yürütülmüştür; yani firmalar, markalarının filmlerde yer alması için filmin yapımcılarına bir bedel ödememişlerdir. Sadece markalarını onlara ödünç vermişlerdir. (Balasubramanian, 1994 a.g.m., pp. 29-47.) 1980'li yıllardan sonra marka yerleştirmenin güçlü bir tanıtım aracı olduğu konusunda fikir birliği sağlanmış ve bu süreçte artık film yapımcılarına ödenen ücretler katlanarak artmıştır.

Modern marka yerleştirmenin ilk uygulandığı filmin E.T. (Extra Terrestrial) olduğunu belirtmekte ve Steven Spielberg'in 1982 yılında çektiği filmde Reese's Pieces şekerlemelerinin Amerika'nın sevimli uzaylısının favori yiyeceği olarak betimlenmesi modern yerleştirmenin gelişimi açısından önemli bir dönüm noktasına işaret etmektedir. (Arslan, 2011: 19-21). Artık işletmelerin

birçoğunun marka yerleştirme ajansları ile iş yaptıkları görülmektedir. Mesela, Apple'ın sadece marka yerleştirme ile uğraşan kendi çalışanları bulunmaktadır.

Tıgılı, Türk sinemasında ise bilinçli olarak yapılan yerleştirmelerin tarihi hakkında resmi kaynak olmadığını ifade etmektedir (2004: 34-35). 1984 yılında Kartal Tibet'in yönettiği "Şen Dul Şaban" isimli filmde Omo ürünü sıkça kullanılırken (Öztürk, 2004) daha sonra "Karışık Pizza" (1998) filminde Pizza Hut'a oldukça yer verilmiştir (Tıgılı, 2004: 35).

3.MARKA YERLEŞTİRMENİN AVANTAJLI VE AVANTAJSIZ YÖNLERİ

Williams ve arkadaşları (Williams ve diğerleri, 2011, ss. 1-24) marka yerleştirmenin amaçlarını ve olası faydalarını ekte görüldüğü şekilde açıklamaktadır:

- Bilinirlik yaratmak ve ilgi uyandırmak
- Markanın farkındalığını sağlamak
- Medya kanalları ile geniş kitlelere ulaşmak ve ürünün çok kısa sürede bilinirliğini artırmak
- İzleyicilerde bu ürünü tercih etmeleri yönünde olumlu fikir oluşturmak
- İzleyicilerin bu ürünü almaya karar vermelerini sağlamak

Televizyon programları film ya da diziler içerisine yapılan marka yerleştirme uygulaması, kısa sürede sosyal medyada yayılmaya başlamaktadır. Firmalar, oyunculara dizi ya da filmin en etkili sahnesinde ürünlerini kullandırmaktadır. Böylece, çok daha etkili bir yöntemle geniş tüketici kitlesine ulaşmak mümkündür (Yazıcı, 2017, ss. 480-489). Marka yerleştirme uygulaması, görsel medya araçlarında aktif olarak kullanılmaktadır. Kreatif ürün yerleştirme uygulamaları televizyon programları, diziler ve videolar yardımı ile çok daha fazla izleyici kitlesine ulaşmak mümkündür (Yazıcı, 2017, ss. 480-489).

Dizi ve film oyuncularının senaryo dahilinde kullandıkları markalı ürünler, izleyicinin de dikkatini çekmektedir. İzleyicinin karakter oyuncusu ile kendisini özdeşleştirme marka farkındalığını da sağlamaktadır. Ünlü ve sevilen sanatçılar marka değerini arttırmaktadır. Ayrıca marka yerleştirmesi uygulaması geleneksel reklam maliyetini de oldukça düşürmektedir. Marka yerleştirme yönteminin, sübliminal bir yönü de vardır. Her zaman fark edilip illa tüketime yönelme yaratması beklenmemelidir. Bazen, bilincin derinliklerinde bir iz bırakmakta, daha sonra o ürüne doğru bir yönelme sağlamaktadır. Reklamların en büyük düşmanı olan ve izleyici kitlenin reklam başlar başlamaz kanalı değiştirmesi bu uygulamada mümkün değildir. Geleneksel reklam türlerinden farklı olarak marka yerleştirmede frekans sınırlaması sonsuza kadar uzanabilmektedir bu da marka yerleştirmenin avantajlı yönüdür. Marka yerleştirmenin birçok avantajlı yönlerinin olması yanı sıra avantajsız yönlerinin de varlığına dikkat çekilmektedir.

Marka yerleştirmenin filmin veya televizyon programının sanatsal dokusuna zarar verdiği ve içeriği ticarileştirdiği yönünde eleştiriler söz konusudur (Tıgılı, 2004: 40). 1989 yılında çocuk ve genç izleyiciler için endişelenen “Çocuk Televizyonu Hareketi” ve “Birleşik İsa Kiliseleri”, Federal İletişim Komisyonu’na başvurarak marka yerleştirme ve benzer uygulamaların denetlenmesini istemişlerdir. Bunun başlıca nedeni, bir televizyon kanalının bir kola işletmesiyle “TV 101” isimli bir çocuk dizisi için marka yerleştirme konusunda protokol imzalamasıdır (Karrh, 1998: 59; McCarty, 2004: 48). Buradan da anlaşılacağı üzere çocuk izleyiciler marka yerleştirmede yanlış mesajlara maruz kalabilirler. Ayrıca çoğu ülkede yasaklanan sigara, alkol, silah vb. ürünlerin, senaryoya yerleştirilmesi toplumun bir kısmı da rahatsız etmektedir.

4. MARKALARIN FİLM SAHNESİNE YERLEŞTİRİLMESİ

Murdock, yaratıcı ve doğal yerleştirme olmak üzere iki tür ayrım yapılmasını önermiştir (1992: 19). Yaratıcı yerleştirmede ürün filme dolaylı yoldan; doğal yerleştirmede ise ürün filmin içine doğal ortamındaki şekliyle yerleştirilmektedir. DeLorme ve Reid (1999: 74) bu iki ayrımın yanında işitsel (sözel) yerleştirmeden söz etmiştir. Bu yerleştirme, marka isminin filmin bir sahnesinde oyuncu tarafından sözlü ifade edilmesidir

Shapiro (1993), marka yerleştirme uygulamalarını dört türde kategorize etmiştir:

- a) Ürünün ya da marka isminin yalnızca açık şekilde görünmesi,
- b) Sözsüz olarak kullanımının ekranda gösterilmesi,
- c) Sözel olarak ifade edilmesi,
- d) Filmdeki ana karakter tarafından kullanılması ve söz edilmesi.

d’Astous ve Seguin, (1999: 898) ürün yerleştirme stratejilerini televizyon sponsorluğu açısından ele alarak üçe ayırmışlardır. Örtülü yerleştirme, ürünün film içerisine açıkça belirtilmeksizin yerleştirilmesidir. Burada ürün, pasif ve bağlamsal bir rol oynamaktadır. Bütünleştirilmiş açık ürün yerleştirme, ürün ya da ürüne ait bileşenin sahnede açıkça gösterildiği ve ürünün aktif rol aldığı yerleştirmedir. Ürünün açıkça gösterildiği ancak sahne içeriği ile bütünleştirilmeyen yerleştirme ise bütünleştirilmemiş ürün yerleştirmedir. Gupta ve Lord (1998) filmlere marka yerleştirmeyi seyircilerin etiksel olarak onaylaması temelinde de ele alarak; gizli yerleştirme ve görünür (açık) yerleştirme biçiminde sınıflandırmıştır.

d’Astous ve Chartier (2000: 900): tüketicilerin olumlu tepki gösterdiği üç çeşit yerleştirme olduğunu ifade etmektedirler

- 1) Ürün bir film yıldızıyla birlikte görüldüğünde,
- 2) Ürün, ürüne uygun bir sahnede gösterildiğinde ve
- 3) Ürün sahnede çok çarpıcı bir biçimde gösterildiğinde

Amerikalı Pqmedia Araştırma Şirketine göre ise marka yerleştirme, işitsel, görsel ve basılı olarak uygulanmaktadır. Pqmedia, marka yerleştirmeyi üç ana çeşide ayırmaktadır: (“Product Placement Spending in Media 2005”)

1. Ödenmiş marka yerleştirme: Marka yerleştirmenin bilinçli şekilde düzenlendiği ve finansal bir karşılığının olduğu yerleştirmedir.

2. Barter: Marka yerleştirmenin yine düzenlendiği ancak ürünün bir karşılık olarak sunulduğu yerleştirmedir.

3. Karşılıksız marka yerleştirme: Yerleştirmenin açıkça olduğu, çoğu kez bir karakterin profilini güçlendirmek ya da plana, işitsel veya basılı metne zenginlik kazandırmak amacıyla yapılan yerleştirmedir.

5.ARAŞTIRMA

5.1.Araştırmanın Amacı

31 hafta boyunca gösterimde kalarak yaklaşık 5.288.987 seyirciye ulaşan ve 64.556.327,85 ytl'lik hasılatı ile Türkiye’de sinema endüstrisinin geldiği parasal noktayı da özetleyen Aile Arasında filminin marka yerleştirme açısından durumu incelenmektedir. Ülkemizde tüm zamanların en çok seyredilen Türk filmler arasında 8. Sıraya giren Aile Arasında filmdeki marka yerleştirme uygulamalarının nasıl yapıldığı, yapılırken senaryo ile bağlantılı olup olmadığı da değerlendirilmektedir.

5.2.Araştırmanın Yöntemi

Toplanan verileri açıklayabilecek kavramlara ve ilişkilere ulaşmak için içerik analizinden yararlanılmıştır (Yıldırım ve Şimşek, 2003: 162). Bu noktadan hareketle öncelikle içerik analizine verilerin kodlanması işlemi ile başlanmaktadır. Bu kodlamada marka yerleştirme ile ilgili olarak Shapiro’nun dört türde kategorize ettiği marka yerleştirme uygulaması dikkate alınmıştır. Shapiro tarafından, ürünün kurgusal örüntüde kullanım derecesine göre yapılmış sınıflandırması kullanılmıştır. Filmde a)Ürünün ya da marka isminin yalnızca açık şekilde görünmesi, b) Sözsüz olarak kullanımının ekranda gösterilmesi, c) Sözel olarak ifade edilmesi, d) Filmdeki ana karakter tarafından kullanılması ve söz edilmesi şeklinde kategorize yöntemi uygulanmıştır.

5.3.Bulgular ve Yorum

5.3.1.Film Hakkında Genel Bilgiler

Bol kahkahalı Aile Arasında Filmi’nin yönetmeni Ozan Açıktan’dır. Senaryosunu ise daha önce dizi film senaryoculuğu yapan Gülse Birsal yapmaktadır. Filmin yapımcılar olarak ise Necati Akpınar, Şebnem Kitiş Vural, Tunay Vural karşımıza çıkmaktadır. Filmin görüntü yönetmeni Yon Thomas’tır.

Vizyona Giriş Tarihi 01 Aralık 2017 olan filmin kurgusu Erkan Erdem tarafından yapılmıştır. 125 dakika boyunca komedi türünde izleyiciye keyifli alanlar yaşatan film, birbirinden yetenekli oyuncular da senaryoya dahil etmektedir. Filmin oyuncuları arasında Engin Günaydın, Demet Evgar, Gülse Birsal, Devrim Yakut, Erdal Özyağcılar, Ayta Sözeri, Şevket Çoruh gibi oyuncular bulunmaktadır.

Aile Arasında, konusu itibarıyla Orhan Aksoy'un Neşeli Günler'i ve Mike Nichols'ın Kuş Kafesi'ni hatırlatan bir yapımdır. İkiyüzlü ahlak ve namus anlayışını eleştiren film bel altı esprilere sırtını fazla dayamadan ve komediyi hiç kismadan hikayenin duygusunu yüksek tutmaktadır. Filmde Adana sıcağında çekilmesi gereken düğün sahneleri İstanbul'da Eylül ortasında 10 derecenin altında bir sıcaklıkta çekilince, oyuncular zor bir kamera arkası süreci yaşamışlardır. Adana şivesi için bir şive koçuyla da çalışılmıştır. Sıcak aile hayatı, komşuluk ilişkilerine gönderme yapan film 'Evli, mutlu, çocuklu', 'Kim bilir', 'Büklüm büklüm' gibi şarkıları sayesinde eğlenceli bir havada oluşturmuştur. Kültür ve Turizm Bakanlığı Sinema Genel Müdürlüğü verilerine göre 2018 yılı en çok seyredilen ilk 5 film arasında 4. olarak yer alan Aile Arasında filmi 64.556.327,85 ytl'lik hasılatı ve 31 hafta boyunca gösterimde kalarak yaklaşık 5.288.987 seyirciye ulaşmasıyla büyük başarı kazanmıştır. Film oyuncularından Ayta Sözeri 23. Sadri Alışık Ödülleri 2018 ödül töreninde En İyi Yardımcı Kadın Oyuncu (komedi) ödülünü, Demet Evgar En İyi Kadın Oyuncu (komedi) ödülünü, Engin Günaydın ise En İyi Erkek Oyuncu (komedi) ödülünü almıştır.

5.3.2.Filmin Oyuncuları Hakkında Bilgi

Filmde Mihriban karakterini Gülse Birsal canlandırmaktadır. Boğaziçi Ekonomi mezunu olan ve 1994 yılında Columbia Üniversitesi'nde sinema üzerine yüksek lisans yapan Gürse Birsal fenomen olan Avrupa Yakası, Yalan Dünya ve Jet Sosyete dizilerinin de hem senaryosunu yazmış hem de başrolünü uzun yıllar üstlenmiştir

Fikret karakterini canlandıran 1972 Tokat doğumlu Engin Günaydın, Mimar Sinan Üniversitesi Devlet Konservatuvarı'ndan mezun olmuştur. Canlandırdığı karakterlerle çok sayıda ödül alan Günaydın dizi oyunculuğunu bırakmış şu anda sadece film oyunculuğuna odaklanmıştır.

Demet Evgar bu filmde Solmaz karakterine hayat vermektedir. İstanbul Üniversitesi Devlet Konservatuvarı Tiyatro Bölümü'nü bitiren, 1 Kadın ile 1 erkek adlı komedi dizisi ile adını duyuran oyuncu, özellikle tiyatro oyunlarının da üstesinden gelmektedir. Başarılı tiyatro oyunculuğu 8. Tiyatro Ödülleri ödül töreninde Yılın Kadın Oyuncusu ödülüne layık görülerek tescillenmiştir. Evgar farklı karakterleri başarı ile canlandıran bir oyuncudur.

1948 yılında Bursa'da dünyaya gelen Erdal Özyağcılar, filmde Haşmet rolünü canlandırmaktadır. Şehnaz Tango, Yabancı Damat, Elveda Rumeli gibi çok yüksek rating alan dizilerde başrol oynayan oyuncu, seslendirme çalışmaları da yapmıştır.

5.3.3.Filmin Öyküsü

Aile Arasında, kadın-erkek ilişkilerinin, evliliğin, aile kavramının, toplumsal ahlak anlayışın mizahla süslenerek sorgulandığı ve vizyonda olduğu dönemde yoğun ilgi görmüş, senaristliğini Gülse Birsnel'in, yönetmenliğini Ozan Açıktan'ın yaptığı bir komedi filmidir. İstanbul'dan Adana'ya uzanan hikayede insan ilişkileri, kültürel farklılıkların da filme yerleştirilmesiyle daha da keyifli hale gelmiştir. İzleyenleri rahatsız etmeyecek şekilde duyulan argo kelimeler, komedi unsuru olmaktan öte, diyalogları güçlendirmek için kullanılmıştır. Filmin kendini tekrar etmeyen sahneleri ile süresi uyumludur. Sinema ve tiyatronun güçlü ve ünlü oyuncularını bir arada görmemiz, filme zenginlik katmıştır.

Solmaz (Demet Evgar) aynı müzikholde çalıştığı ve kızının da babası olan Neco (Şevket Çoruh) ile evlenmeyi beklerken, Neco bir başka kadın için Solmaz'ı terk eder. Filmin bir diğer kahramanı avizeci Fikret'ti de 21 yıllık eşi Mihriban (Gülse Birsnel) boşamaya karar verir. Solmaz ve Fikret, yanlış anlamalar üzerine kurulmuş bir buluşmayla tanışırlar. Hikayenin asıl renkli kısmı bundan sonra başlar. Solmaz ve Neco'nun kızları Zeynep (Su Kutlu), Adanalı ve gelenekçi bir ailenin oğlu olan Emirhan (Fatih Artman)'dan evlenme teklifi alır. Bu güzel teklif ciddi bir sorunu da beraberinde getirir, Solmaz ve Neco'nun yaptıkları işler... Neco, kız isteme törenine yanaşmaz. Acil ve geçici olarak Zeynep'in babasını oynayacak birine ihtiyaç vardır, Fikret'in kapısı çalınır. Solmaz, Zeynep, Behiye (Ayta Sözeri) ve Leyla (Derya Karadaş) ile birlikte aynı evde yaşamaya başlayan Fikret, başlarda teklifi reddetse de sonrasında razı olur. Emirhan'ın geleneksel ailesinin Adana'dan gelerek (Mükerrem, Haşmet, Kahraman ve Gülümser) Zeynep'i istemeleriyle başlayan yanlışlıklar komedisi içinde, aileler birbirlerine kültürel olarak hiç de uygun olmadıklarının gayet farkında olarak, evlenme hazırlıklarını devam ettirirler. Tüm bu süreçte türlü aksilikler, yalanlar, saklanan sırlar peşlerini bırakmaz. Düğün gecesi tüm gerçeğin ortaya çıkmasıyla birlikte aşk, aile, evlilik, ahlak kavramları yeniden düşündürülür izleyiciye, gerçek her zaman görüldüğü gibi değildir. Olanlara rağmen Zeynep ve Emirhan birbirlerinin ellerini bırakmaz. Haşmet (Erdal Özyağcılar) eşi Mükerrem (Devrim Yakut)'den ayrılır ve Solmaz'ların evine taşınır. Geçmişlerini geride bırakmış Solmaz ve Fikret ise izleyenleri gülümseten bir sahneyle hayat yolculuğunu birlikte yapmaya karar verirler.

5.3.4.Filmin Marka Yerleştirme Uygulamaları Açısından Değerlendirilmesi

Efes Bira

(00:04:12 – 00:04:58) Açık Olarak Gösterme



Türkiye’de televizyon ve radyo gibi kitle iletişim araçlarında yasaklı ürün kategorisinin başında alkol gelmektedir. Çeşitli mecralarda yayınlanması yasak olan ürünler, sinema filmlerini markalarını yerleştirmek için kullanılmaktadır. Sinemada marka yerleştirme, sınırlı mecra kullanım olanağına sahip yasaklı ürünler için vazgeçilmez bir iletişim yöntemidir.

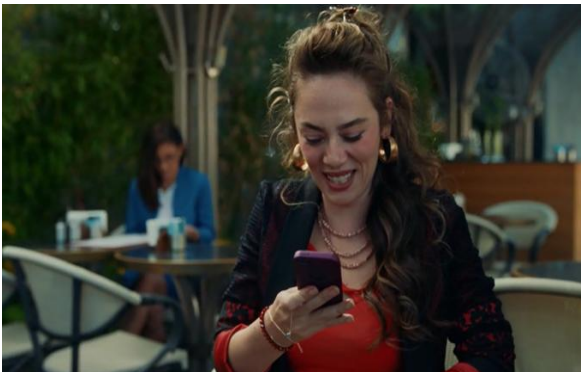
Filmde (00.04.12-00.04.58) süre aralığında Efes Bira markasına ait iki ayrı ürünün yer aldığını görüyoruz. Evdeki eşyaların karmaşasına uyumlu olarak bira kutuları yerleştirilmiştir. Marka adı açıkça görülmemekle birlikte, ürünlere ait renk ve tasarımlardan marka açıkça anlaşılmaktadır. Neco (Şevket Çoruh)’un Solmaz (Demet Evgar)’ı terk etmeye (kaçmaya) çalışırken, kendini pencereden sokağa atma çabası içinde “Solmaz, senden tek bir ricam var, şu biramı verir misin” demektedir.

00:28:01 – 00:28:28 Açık Olarak Gösterme

Filmde yine 00:28:01– 00:28:28 süre aralığında Efes Bira kutusu tekrar görülmektedir. Bu sahnede Solmaz, kızı Zeynep’in evleneceğini haber vermek için Neco’yla konuşmaya gider. Neco barda bira içmektedir. Neco’nun sağında Efes Pilsen bira kutusu durmaktadır. Söz konusu marka yerleştirme senaryoyla ilişkili olarak 14 saniye boyunca kullanılmıştır.

Iphone Telefon

(00.12.00-00.12.16) Kullanım Yollu Gösterme



Adeta bir ikon haline dönüşen iPhone, dünyanın birçok ülkesinde telefon kullanıcılarının vaz geçilmez markası haline dönüşmüştür. Steve Jobs tarafından Apple'da çalışmak üzere işe alınan ve şirketin CEO'luğunu yapan Tim Cook Apple'ın, 2007 yılından 2017 yılına kadar 1.2 milyar kümülatif iPhone sattığını açıklamıştır. Seçici ve hedefe yönelik reklam stratejisi oluşturan Apple iPhone, marka yerleştirme yöntemi üzerinde yoğunlaşmıştır ve gişe başarısı yakalayabilecek potansiyeli olan filmlere uzun yıllardır marka yerleştirme yapmaktadır. Filmde Fikret (Engin Günaydın) ile Solmaz (Demet Evgar)'ın aynı kafede birbirlerini aslında buluşmayı beklediklerini kişi zannederek sohbet başladıkları sırada, Solmaz çantasından Iphone telefonu çıkartıp konuşmaya başlar. Marka açıkça görülmez. Telefonun arka yüz tasarımından Iphone olduğu anlaşılmaktadır.

Kanyon Avm

(00:16:07 – 00:16:12) Açık Olarak Gösterme



5 bin metrekareden fazla kiralama alanına sahip taşınmazların ortak adı olan alışveriş merkezleri tüketicilerin her tür ihtiyacını karşılamak üzere birden fazla satıcının bulunduğu alanlardır. Tüketicilerin yeni sosyalleşme alanı olan ve özellikle kış mevsimlerinde kişi sayısını arttıran alışveriş merkezleri her geçen gün sayılarını çoğaltmaktadır. Türkiye genelinde avm sayısı 396 'yı bulurken, 114 avm ile İstanbul en yüksek avm'ye sahip şehir olarak karşımıza çıkmaktadır. Alışveriş merkezlerinin iletişimi yapan ajanslar yoğun rekabet ortamında farkındalık yapmak için özellikle son yıllarda sinema filmlerine marka yerleştirme yapmaktadır. Filmde İstanbul Levent'te Eczacıbaşı Topluluğu ve İş Gayrimenkul Yatırım Ortaklığı tarafından yaptırılmış özel tasarımı olan ve dünyaca ünlü birçok markanın bulunduğu Kanyon Alış Veriş Merkezi de bulunmaktadır.

Filmde Zeynep (Su Kutlu) ve Emirhan (Fatih Artman) birlikte Kanyon AVM'nin önünde el ele yürümektedirler ve marka açıkça görülmektedir.

Subaru Otomobil

(00:16:13 – 00:16:25) Kullanım Yollu Gösterme



Günümüzde özellikle ABD’de ekranlarda marka yerleştirme olarak en çok görünen marka Apple’dır. En iyi 33 filmin %30’unda Apple’in bir ürününe rastlanmaktadır. Apple’dan sonra ikinci sırayı paylaşan markalar Nike, araba markaları Chevrolet ve Ford’dur. Üçüncü sırada ise Sony, Dell, Land Rover ve Glock var. Amerika’lı yapımcılar iyi markaların kendi programlarında yer almasını imaj olarak önemli buluyor ve gerekirse çok düşük bütçelerle veya barter sistemiyle o markanın kendi programında/dizisinde/filminde yer almasını sağlıyor (Cemre Erol, 2017) Buradan da anlaşılacağı üzere özellikle araba markaları filmlere yoğun olarak marka yerleştirme uygulaması yapmaktadır. Bu uygulamalar hem markalar için hem de film yapımcıları için karşılıklı çıkar alış verişine dönmüştür.

Filmde (00.16.13-00.16.25) süre aralığında Zeynep ve Emirhan Kanyon AVM’nin önünden el ele yürüyerek geçtikten sonra rengi, modeli ve markası görülen Subaru otomobile binerler. Maddi durumu iyi olduğu için Emirhan’ın filmde Subaru markası tercih etmesi şaşırtıcı değildir. Filmde kullanılan tüm otomobil ve jeepler aynı markaya aittir fakat ekranda marka ismi ve logosu gözükmemektedir. Burada Subaru otomobil farkındalık yapmak, görünür olmak, olumlu imaj sağlamak, satış ve pazarlamayı desteklemek gibi gerekçelerle marka yerleştirme yapmaktadır.

Koçtaş

(00:19:02 – 00:19:20) Açık Olarak Gösterme



Türkiye’de 20 ilde 42 Koçtaş ve 21 Koçtaş Fix mağazasında 234 bin m2’lik satış alanı ile yerli ve ithal çok sayıda markanın ürünlerini uygun fiyat ve kolay ödeme avantajıyla müşterilerine sunan Koçtaş, Brand Finance tarafından yapılan araştırmaya göre de en Değerli ilk 100 Türk şirketi arasında 50. Sırada yer almaktadır. Ev perakendeciliğinin önemli markası olan Koçtaş, dijital pazarlama kampanyaları, yaratıcı reklam stratejileri ile de çeşitli ödüllere layık görülmüştür.

Filmde (00.19.02-00.19.20) süre aralığında Solmaz ve Fikret, Fikret’in odası için Koçtaş yapı markete alışveriş yapmaya giderler. Yapı market içindeki ürünlerin raflara yerleştiriliş sisteminden, fiyat etiketlerinin tasarımından ve markanın kurumsal rengi olan turuncunun kullanımından markanın yerleştirildiği anlaşılmaktadır. Markanın yerleştirilmesi senaryo ile ilişkili kullanılmıştır. Marka açık olarak gösterilmiştir.

Marks&Spencer

(00:26:50 – 00:26:55) Açık Olarak Gösterme



ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Mağazacılık sektöründe yer alan Marks & Spencer 100 yılı aşkın süredir müşterilerine hizmet veren bir İngiliz markasıdır. Türk müşterileriyle 1995 yılında buluşan marka, ‘ürün, hizmet standartlarıyla her beden ve ölçüde, kaliteli, şık ve rahat giyinebilme imkanı sunma misyonuna sahiptir. FIBA Perakende Grubu ile stratejik ortaklık yapan Marks & Spencer çeşitli iletişim kanallarından markanın imajı için reklamlar vermektedir.

Filmde Solmaz (Demet Evgar), Fikret (Engin Günaydın), Behiye (Ayta Sözeri) ve Leyla (Derya Karadaş) alış verişe giderler. Alış veriş sonrasında Marks&Spencer yazılı torbalar ellerinde görülür şekilde yürümektedirler.

Vakko

(00:47:15 – 00:47:56) Kullanım yolu gösterme

Vitali Hakko tarafından kurulan Vakko, Türk giyim sanayiine farklılık getirmiştir. ”Tasarım”, “yenilikçilik” ve “kalite” ile özdeşleşen Vakko hızlı bir “marka yaratma süreci” yaşamıştır. 1982 yılında genç kesime hitap eden Vakkorama, 1989’da Vakko Çikolata, 1990’da Vakko Parfüm ve daha sonraki yıllarda H2O, V2K, W, Vakko Cruise gibi markaların yanı sıra Vakko Dekorü da faaliyete geçirmiştir.

Kız istemek için Emirhan ve ailesi Zeynep’in evine gider. Emirhan’ın annesi Mükerrerem’in elinde Vakko siyah el çantası vardır. Vakko çanta ekranda 5 saniye süre ile görünmektedir. Zenginliğin simgesi olarak kullanılan markanın yerleştirilmesi senaryo ile ilişkili kullanılmıştır.

Malboro Light

(00:48:12 – 00:48:14) Kullanım Yollu Gösterme



Tütün üreticileri filmlerdeki reklam olarak sigara kullanımının ne denli etkili olduğu uzun zamandır bilinmektedir. Ve bu doğrultuda çalışmalarını sürdürmüşlerdir. Filmlerde sigara kullanımı büyük ölçüde hüküm sürmektedir (Mekemson ve Glik:2004:400). Philip Morris şirketi, Süpermen 2 filmine para vererek Marlboro sigara reklamlarının film içine yerleştirmesini sağlamıştır (Charlesworth

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

ve Glantz, 2005:1516). Philip Morris 1978 yılından sonra modern ürün yerleştirme çalışmalarına başlamış Philip Morris markası (Marlboro) Filmleri yerli yabancı birçok film içerisinde görülmüştür. Philip Morris (Marlboro) markasını filmlerde sigara tüketimini arttırmak, markayı hatırlatmak amacıyla kullanmaktadır.

Filmde Behiye ve Leyla, yaşadıkları evin bahçesinde kahve içerlerken, Leyla çantasından içmek için sigara paketini çıkarır. Marka açıkça görülmez. Sigara paketinin tasarımından marka anlaşılmaktadır. Burada marka kullanım yoluyla gösterilmiştir.

Troy Card

(00:55:55 – 00:55:57)Kullanım yolu gösterme



Troy, Bankalararası Kart Merkezi A.Ş. (“BKM”) tarafından kurulan ve işletilen bir kartlı ödeme sistemidir. BKM, TROY faaliyetleri için 31 Mart 2016 tarihinde BDDK’ dan kartlı sistem kurmak üzere faaliyet izni almıştır. Troy, nakitsiz ödeme yapılmasını sağlayan bir altyapıdır. Troy markası iletişim çalışmalarında ‘Türk halkına yönelik ödeme alışkanlıklarına vurgu yapan’ reklam kampanyaları düzenliyor. Bu doğrultuda Aile Arasında filmi Türk milli markası açısından çok doğru bir film olarak seçilmiş durumdadır.

Filmde Zeynep ve Emirhan’ın nişan alışverişine gidilen sahnede Mükerrerem Kurt (Devrim Yakut) çantasından Troy Card’ı çıkarıp kasiereye uzatır. Marka açıkça görülmektedir.

Mac Cosmetic

(00:56:01 – 00:56:19)Açık olarak gösterme



Kozmetik sektörünün önemli temsilcilerinden olan ve 1985'te ikisi de makyaj sanatçısı olan gay bir çift tarafından kurulan M.A.C bugün dünyanın en çok satan profesyonel kozmetik markalarından biridir. M.A.C makyaj sanatçılığı konusunda uzman olduklarını iddia eden bir markadır. Roberto Cavalli defilesinde de Steven Spielberg filminde de bu marka kullanılmaktadır. Aktif sosyal medya ve acık hava reklamcılığını yürüten AIDS fonuna destek veren M.A.C markası, filmlerde marka yerleştirme stratejisini de zaman zaman kullanıyor.

Filmde (00.56.01-00.56.19) süre aralığında nişan alış verişini sonrasında Gülümser (Devin Özgür Çınar)'ın elinde, Gülümser, Mükerrrem, Haşmet (Erdal Özyağcılar) ve Kahraman (Deniz Şen Hamzaoğlu)'nın kafede oturdukları sahnelerde, Mac Cosmetic torbası açıkça görülmektedir.

Kitchenette

(00:56:04 – 00:56:29) Açık Olarak Gösterme



Son yıllarda yeme-içme ve eğlence markaları da farkındalık yaratmak ve olumlu imaj yaratmak için mekan kullanımı olarak filmlerde çoğu zaman kendi markalarına marka yerleştirme yaptırmaktadır. Dünya mutfaklarından farklı lezzetleri sunan modern ve rahat atmosferi ile müşteriyi yakalayan Doors Grup bünyesinde bulunan Kitchenette markası da filmlerde görülmektedir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Filmde Gülümser, Mükerrerem, Haşmet ve Kahraman'ın kafede oturdukları sahnede, masanın üzerindeki peçetelikte ve kağıt peçetelerde Kitchenette markası açıkça yazmaktadır.

Bahçeşehir Koleji

(01:10:40 – 01:10:41) Açık olarak gösterme



Aile Arasında filminin ana sponsoru Bahçeşehir Koleji'dir. Sunar-Sundu değil, sadece ana sponsor olarak geçmektedir. Filmde kurum logosu açıkça gösteriliyor. Ancak bu sahne sadece 2 saniye. Bu sayede kurumun reklamı, filmin yarattığı havayı bozmuyor. Ana sponsorluk karşılığında, diğer sponsorlardan farklı olarak afişte, galalarda logo konumlandırma hakkı, backstage görüntüleri pazarlama faaliyetleri kapsamında kullanma hakkı ve öğrencilerine belli sayıda ücretsiz bilet hakkına sahip oldular. Başarılı bir sponsorluk uygulaması olarak tarihe geçti. (Alper koç, 2017)

Solmaz, Zeynep, Fikret, Leyla ve Behiye düğün için Adana'ya giderler. Uçağa binerken aldığı ilacın etkisiyle Fikret istem dışı davranmaya başlar. Sarhoş gibidir adeta. Yola kaçan bir topu çocuklara atmak isterken kendini futbol oynarken bulur. Oynadıkları yer Bahçeşehir Koleji'nin bahçesidir ve marka açıkça görülür. Burada marka 2 sn açıkça logosu gösterilerek verilmektedir.

Kütahya Porselen

(01:10:47 – 01:10:49) – Kullanım yollu gösterme



ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

1974 yılında Nafi Güral tarafından Kütahya Porselen kurulmuştur. Türkiye'nin milli markası Kütahya Porselen, Türkiye'deki porselen serüveninin de öncüsüdür. Farklı ve özgün tasarımda porselen takımları üreten Kütahya Porselen, diğer seramik üreticilerine de malzeme temin eden bir sektör devidir. Kütahya Porselen yıllardır dizi filmleri eğlence programları ve filmlere yaptığı sponsorluklarla da adını duyurmaktadır.

Adana'da Mükerrerem ve Haşmet'in evine giderler ve kahve içilir. Fincanın altında Kütahya Porselen markası görülür. Saniye sonrasında Fikret tekrar kahve içerken yine fincanın altındaki Kütahya porselen yazısı 2 saniye süre ile görünmektedir. Kullanım yolu gösterme ile marka yerleştirilme yapılmıştır.

Gold Saat

(01.20-51 – 01.22.11) Açık olarak gösterme



Solmaz ve Leyla düğünde giymek için kıyafet almaya giderler. Haşmet ve Kahraman'da onlara eşlik eder. Kıyafetlerin denendiği mağazanın yanında, Gold Saat markasıyla bir diğer mağaza açıkça görülmektedir.

Doğadan Çay

(01.39.46 – 01.40.00) Kullanım yolu gösterme



Türk eczacı Nevzat Karpuzcu'nun 1975 yılında kurmuş olduğu Doğadan Şirketi, Türkiye'nin bu konuda ilk bitkisel şekilde hazırlanan çay markası ve ilk poşet çay üreticisi olarak yer aldı. 1985 yılında marka tescillenmiştir. Bitki ve meyve çayları piyasasında yıllık olarak 770 milyon poşetlik üretim kapasitesine sahip olan Doğadan 2015 yılında Coca Cola Şirketi'ne devredilmiştir. Marketing Türkiye Türk reklamcılığının en başarılı viral reklamları arasında Doğadan reklamlarını da göstermiştir. Filmde Solmaz, Zeynep ve Fikret, Adana'da kaldıkları otelin odasında sohbet etmektedirler. Bu sırada Fikret, fincanda Doğadan markalı poşet çay içmektedir. Marka görülür.

Karaca Gömlek

3 Saniye Kullanım Yollu Gösterme

Karaca markası 1917 yılında kurulur ve 1961 yılında yurt dışına ihraç edilen ilk Türk Tekstil markasıdır. 1998 yılında Tekfen Holding bünyesine katılan Karaca, 2005 yılında Narin Group ailesine katılır ve markalaşma yolunda atağa kalkar. Karaca markası Avrupa ve Ortadoğu'da birçok ülkeye ihracat yapan Narin Group bünyesinde farklı ülkelerde ihraç edilmektedir.

Hikmet'in üzerindeki tişörtte Karaca logosu belirgin şekilde görünmektedir. Karaca marka gömlek ekranda 3 saniye süre ile görünmektedir.

Marka yerleştirme barter (takas) biçimli yapıldığında uygulama sponsorluğa yaklaştırmakta ve markanın akışına dahil edildiği filmi bir açıdan desteklemesi koşuluyla reklamının yapılması da söz konusu olmaktadır. Filminin ana sponsoru Bahçeşehir Koleji'dir. Okul sponsorluk sayesinde filmin 00.70.40'ncı dakikasında yaklaşık 2. sn olarak görülmektedir. Bu sponsorlukla medya da kendinden oldukça söz etmiş, çeşitli haberleri çıkmıştır. Film içerisinde 16 tane marka kullanılmıştır. 16 tane marka incelendiğinde tüm dünyada tanınan ve satışı olan Iphone, Marlboro, Mac Cosmetic, Subaru, Marks & Spenser gibi markaların varlığı yanı sıra, Efes Bira, Doğadan Çay, Gold Saat, Kütahya Porselen, Bahçeşehir Koleji, Kitchenette, Troy Card, Kanyon Avm, Koçtaş, Vakko, Karaca gibi yerel markalarda kullanılmıştır. Film içinde yerel markaların çoğunlukta olduğu görülmektedir. Alkol, tekeli, otomobil markası, eşya, kıyafet, çanta markası, alışveriş merkezi, alışveriş kartı, yeme- içme eğlence mekanı, eğitim kurumu, porselen, çay gibi ürünlerin markaları filmde yer almıştır.

Türkiye'de reklamı yapılması yasaklı markalar kategorisine giren Efes Bira ve Marlboro markaları tanıtım için alternatif kanal olarak marka yerleştirme yapmışlardır. Filmde marka yerleştirme kullanım yollu gösterme ve açık olarak gösterme şeklinde yapılmıştır. Film incelendiğinde hiçbir marka sözel olarak ve ana karakter tarafından hem kullanılıp hem de söz edilerek ifade edilmemiştir. Filme yapılan marka yerleştirmeler, bazı film eleştirmenlerini rahatsız etse de çoğu izleyiciyi alışık olduğu için aynı tepkiyi vermemiştir. Markaları ekranda göstermek için çok uzun zaman aralıkları da

kullanılmamıştır. Bu da bunalıcı bir etki yaratılmamasına neden olmuştur. Ayrıca çoğunlukla filmde yer alan marka yerleştirmeler senaryo ve karakterle ilişkilendirilmiştir.

6.SONUÇ

Marka yerleştirmede izleyicilere seçilen markanın mesajlarının belli bir bedel karşılığında gösterilmesi niyeti söz konusudur. Marka yerleştirme artık iletişim kanallarının hemen hepsinde aktif olarak kullanılmakta ama özellikle sinema filmleri reklam ajanslarının gözdesi durumuna gelmiştir. Sinema ile belli bir hedef kitleye etkili bir biçimde ulaşabileceklerini ve daha az maliyetle imaj oluşturma, imaj pekiştirme, tanıtım yapma, görünür olma, algı yönetimi, itibar yönetimi, satış ve pazarlamaya destek gibi işlevleri yapabileceklerini fark eden markalar bu yöntemi yoğun olarak kullanmaktadır. Alkol ve tekeli ürünleri markaları ise çoğu ülkede ve çoğu iletişim kanalında yasaklı ürünler kategorisinde oldukları için sinemada marka yerleştirme onlar adına vazgeçilmez bir tanıtım aracıdır.

Sinema film yapımcıları çekim, senaryo, kurgu, filmde kullanılacak ürünlerin temini ve kast aşamasında artan maliyetleri düşürmek ve filmin itibarını da sağlamak için markalarla özellikle çalışmaktadır. Ulusal çapta ve dünya çapında vizyona giren filmler etkinliklerine göre marka yerleştirme için reklam ajanslarının dikkatini çekmektedir.

İzleyicilerin açısından bakıldığında ise izleyiciler, klasik reklamlardan bunalmış durumdadırlar. Film aralarına senaryo dahilinde yerleştirilen marka yerleştirme uygulamasından ise onlar adına kaçış yoktur. Yapılan çoğu araştırmada ise filmlere yapılan marka yerleştirme uygulamalarının, tüketiciler tarafından ürün yerleştirmelerin kabul edilebilirliği üzerinde pozitif yönde etkili olduğu ve güvenilir bulunduğu görülmektedir. Filmlerde yaratıcı marka yerleştirme stratejileri de izleyicilerin markalarla etkili bir iletişime girmelerini de sağlamaktadır.

Aile Arasında filmi değerlendirdiğimizde ise kullanılan marka yerleştirmelerin bilinçli olduğu ve film içerikleriyle marka yerleştirmelerin uyumu dikkate alınmıştır. Filmde görsel yerleştirme stratejisi hem de pek çok sahnede de kullanım yolu ile gösterme stratejisi eşit olarak belirlenmiştir. Filmde yer alan 16 marka toplam **4 dakika 47 Saniye** boyunca kullanılmıştır. Filmde markaların kullanım sürelerine bakıldığında izleyiciyi sıkmayan bir sürede yerleştirildiği görülmektedir.

Filmde hem dünya tanınan hem de Türkiye'nin milli markalarının alkol, tekeli, otomobil markası, eşya, kıyafet, çanta markası, alışveriş merkezi, alışveriş kartı, yeme- içme eğlence mekanı, eğitim kurumu, porselen, çay gibi yer alması çok sesliliği de bir işarettir. Her türlü Pazar segmentinde yer alan markaların filmlere marka yerleştirmek için çaba harcadığı tespit edilmiştir.

Film ekibi ile marka verenlerin çıkar ilişkisi bu filme de yansımıştır. Filmden reklamcılar, bu kadar çok kişiye ulaştığı için, yapımcılar maddi anlamda kazanç sağladıkları için ve izleyiciler de bol bol kahkahalı zaman geçirdikleri için memnun ayrılmıştır.

KAYNAKÇA

- Albayrak, H. A. (2017). “Aile Arasında’çözelim Sonra Yine Güleriz”, <http://www.ekdergi.com/aile-arasinda-cozelim-sonra-yine-guleriz/>, (21.11.2018)
- Arslan, E. (2011). “Hollywood A.Ş. Sunar: Ürün Yerleştirme”, İstanbul: Beta
- ASU (2005). “Product Placement Spending in Media 2005”, <http://www.asu.edu/educ/eps/CERU/Articles/CERU-0505-127-Owl.pdf>, (18.11.2018)
- Balasubramanian, S. K. (1994). “Beyond Advertising and Publicity: Hybrid Messages and Public Policy Issues”, *Journal of Advertising*, 4, 33.
- DeLorme, D. E. ve Leonard, R. N. (1999). “Moviegoers’ Experiences and Interpretations of Brands in Films Revisited”. *Journal of Advertising*, 28(2): 71-95.
- Charlesworth, A. ve Glantz S.A. (2005). “Smoking in the Movies Increases Adolescent Smoking: A Review”. *Pediatrics*, 116(6): 1516-1528
- d’Astous, A. ve Seguin, N. (1999) “Consumer Reactions to Product Placement Strategies in Television Sponsorship”, *European Journal of Marketing*, 33 (9/10): 896-910.
- d’Astous, A. ve Chartier, F. (2000) “A Study of Factors Affecting Consumer Evaluations and Memory of Product Placements in Movies” *Journal of Current Issues and Research in Advertising*, 22 (2): 31-40.
- Deloitte (t.y). “Türkiye’de Medya ve Reklam Yatırımları”, <https://www2.deloitte.com/tr/tr/pages/technology-media-and-telecommunications/articles/turkiyede-tahmini-medya-ve-reklam-yatirimlari.html>, (15.11.2018)
- Ginosar, A. & Levi-Faur, D. (2010). Regulating Product Placement in the European Union and Canada: Explaining Regime Change and Diversity”. *Journal of Comparative Policy Analysis*, 12(5): 467-490.
- Hürriyet (2004). “Önce starları, sonra sokakları ele geçiren makyaj markası Türkiye’de”, <http://www.hurriyet.com.tr/kelebek/once-starlari-sonra-sokaklari-ele-geciren-makyaj-markasi-turkiye-de-38628100>, (15.11.2018)
- Karrh, James A. (1998). “Brand Placement: A Review”, *Journal of Current Issues and Research in Advertising*, 20(2): 31-49.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Koç (t.y). “Koçtaş”, <https://www.koc.com.tr/tr-tr/faaliyet-alanlari/sectorler/diger/koctas>, (19.11.2018)
- Koç, H. A. (2018). “Gülse Birsal Tarzı Ürün Yerleştirme”, <https://pazarlamaturkiye.com/sponsorluk/gulse-birsal-tarzi-urun-yerlestirme/>, (21.11.2018)
- Kütahyaporselen (t.y). “Porselen Hakkında”, <https://kutahyaporselen.com/porselen-hakkinda>, (16.11.2018)
- Linstrom, M. (2009). “Buy.ology”.İstanbul: Optimist Yayınları
- Marketing Türkiye (2017). “Türk reklamcılığının en başarılı viral reklamları...”, <http://www.marketingturkiye.com.tr/haberler/turk-reklamciliginin-en-basarili-viral-reklamlari/>, (19.11.2018)
- Mekemson, C., Glik, D., Titus, K., Myerson, A., Shaivitz, A., Ang, A., ve Mitchell, S. (2004). “Tobacco use in popular movies during the past decade”. Tobacco control, 13(4): 400-402.
- McKechnie, S. A. ve Zhou, J. (2003). Product Placement in Movies: A Comparison of Chinese and American Consumers. International Journal of Advertising, 22(3), 349- 374
- McCarty, A. J. (2004). “Product Placement: The Nature of the Practice and Potential Avenues of Inquiry” içinde The Psychology of Entertainment Media, (2012) L. J. Shrum and L. J. J. Shrum (edS.), 2. ed. Routledge Academic, U.S.A: 45-63.
- Milliyet (t.y). “Vakko 75 Yaşında”, <http://www.milliyet.com.tr/yazarlar/gungor-uras/vakko-75-yasinda-1910989/>, (16.11.2018)
- Murdock, G. (1992): 19 içinde Öztürk, S. A. (2003) “Bir Pazarlama Aracı Olarak Etkileri ve Etkiledikleri Açısından Sinema Filmlerine Ürün Yerleştirme”, Pİ:Pazarlama ve İletişim Kültürü Dergisi, 3 (3): 25.
- Nelson, M. R. (2002). “Recall of Brand Placements in Computer/Video Games”. Journal of Advertising Research, 2(42): 80-92
- NTV (2018). “Aile Arasında tüm zamanların en iyi gişe yapan Türk filmleri listesinde”, <https://www.ntv.com.tr/galeri/sanat/aile-arasinda-tum-zamanlarin-en-iyi-gise-yapan-turk-filmleri-listesinde,zStHr9V1tkyNONoyKBSnyg>, (16.11.2018)
- Odabaşı, Y. ve Oyman, M. (2002). “Pazarlama İletişimi Yönetimi”. Eskişehir: MediaCat
- Öztürk, E. (2004). “Markalar Hollywood’a Ortak Oldu”. Marketing Türkiye, 43: 38-40.
- Pazarlama (2017). “Pazarlama 3.0”, <http://www.pazarlama30.com/urun-yerlestirmeli-mi-yoksa-yerlestirmemeli-mi/>, (14.11.2018)

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Percy, L., Rossiter, J. R. ve Elliot, R. (2004). "Strategic Advertising Management". New York: Oxford University Press

Reijmersdal, E. V., Smith, E. ve Neijens, P. (2010) "How Media Factors Affect Audience Responses to Brand Placement", *International Journal of Advertising*, 29(2): 279-302.

Shapiro, M. (1993) "Product Placements in Motion Pictures", Working Paper, North Western University

Shiftdelete (2017). "Bugüne kadar kaç adet iPhone satıldı?", <https://shiftdelete.net/bugune-kadar-kac-adet-iphone-satildi-83972>, (16.11.2018)

Snatchfold, D. (2005) "Rules of Engagement", *Admap*, 464: 48-50.

Sen, C. (2010) "The Influence of Brand Placement in Bollywood on the Indian Consumer". Yüksek Lisans Tezi, University of Southern California, The Faculty of the USC Graduate School

Tıgılı, M. (2004). "Bir Aktör Olarak Markalar: Ürün Yerleştirme". İstanbul: Türkmen

Troyödeme (t.y). "Ne Yapıyoruz", <https://troyodeme.com/hakkimizda/ne-yapiyoruz/>, (18.11.2018)

Yazıcı, F. (2017). "Türkiye'de Ulusal Televizyon Kanallarında Ürün Yerleştirme Uygulaması". *Avrasya Sosyal ve Ekonomi Araştırmaları Dergisi (ASEAD)*, 4(12): 480-489

Yıldırım, A. ve Simsek, H. (2003). "Sosyal Bilimlerde Nitel Araştırma Yöntemleri", Ankara: Seçkin Yayıncılık.

Williams, K., Petrosky, A., Hernandez, E. ve Page Jr, R. (2011). "Product Placement Effectiveness: Revisited and Renewed". *Journal of Management and Marketing Research*, 7: 1-24.

**KLASİK VE MODİFİYELİ SÜPER ETKİNLİK MODELLERİ İLE YENİLENEBİLİR
ENERJİ AÇISINDAN YILLARIN ETKİNLİĞİNİN DEĞERLENDİRİLMESİ**

Serpil GÜMÜŞTEKİN AYDIN*

ÖZET

Veri Zarflama Analizi (VZA), performans ölçümü için üretim yönetimi bağlamında güçlü bir araçtır. VZA'nın amacı, birden çok girdinin birden çok çıktıya dönüştürüldüğü bir dizi karar verme biriminin (KVB) görece verimliliğini ölçmektir. Klasik VZA modellerinin, etkin olan birimler arasında en etkin olanın hangisi olduğunun belirlenememesi veya girdi ve çıktı değişkenlerinin negatif olması gereken durumlarda problemin çözülmemesi gibi dezavantajları vardır. Bu sorunu ortadan kaldırmak için, Andersen ve Petersen (1993) süper etkinlik modelini önermişlerdir. Ancak, süper etkinlik modeli de kullanılan uzaklık fonksiyonuna göre değişiklik göstermektedir. Bu çalışmada, Türkiye'ye ait yenilenebilir enerji verileri kullanılarak 2006 – 2015 yılları arasındaki en etkin yılın bulunması için klasik ve modifiyeli süper etkinlik modelleri kullanılarak etkinlik hesabı yapılmıştır. Elde edilen sonuçlara göre, iki yöntem birbiriyle karşılaştırılmıştır.

Anahtar Kelimeler: *i Yenilenebilir Enerji, Süper Etkinlik, Radyal, SBM, Verimlilik*

JEL Kodları: *C44, C61, C67.*

**EVALUATION OF THE EFFICIENCY OF RENEWABLE ENERGY USING CLASSIC
AND MODIFIED SUPER EFFICIENCY MODELS**

ABSTRACT

Data Envelopment Analysis (DEA) is a powerful tool in the context of production management for performance measurement. The goal of DEA is to measure the relative efficiency of a number of decision-making units (KVB) where multiple inputs are converted into multiple outputs. The classical DEA models have the drawbacks of not being able to determine which of the most effective units are active, or the problem cannot be solved when the input and output variables should be negative. To eliminate this problem, Andersen and Petersen (1993) proposed a model of super efficiency. However, the super efficiency model also varies according to the distance function used. In this study, using renewable energy data for Turkey from 2006 to 2015, classic and modified super efficiency models was

* Ondokuz Mayıs Üniversitesi, Fen Edebiyat Fakültesi, İstatistik Bölümü, Samsun, Türkiye, E – mail: serpil.gumustekin@omu.edu.tr

examined for the presence of the most efficient years. According to the results, two methods were compared with each other.

Keywords: *Renewable Energy, Super Efficiency, Radial, SBM, Productivity*

JEL Codes: *C44, C61, C67.*

1.GIRIS

Yenilenebilir enerji kaynakları uzun yıllardan beri insanlar için önemli olmuştur. Türkiye, enerji ihtiyacının yarısından fazlasını ithalat le sağlayan enerji ithalatçısı bir ülkedir ve hava kirliliği günden güne ülkede büyük bir çevresel sorun haline gelmektedir. Bu bağlamda, yenilenebilir enerji kaynakları, Türkiye'deki sürdürülebilir enerji gelişimi ve çevre kirliliğinin önlenmesi için en etkili çözümlerden biri gibi görünmektedir. Türkiye'nin coğrafi konumu, yenilenebilir enerji kaynaklarının çoğunun kapsamlı kullanımı için birçok avantaja sahiptir. Yöneticiler enerji sürdürülebilirliğini sağlamak istediklerinde iki temel kaygıyı dikkate alır: enerji kaynaklarının yetersizliği ve enerji kullanımının istenmeyen etkisi. Kaynak eksikliği ile mücadele etmek için etkili enerji tüketim stratejileri oluşturmaya ve enerji üretmek için gerekli girdilerin azaltılarak yenilenebilir enerji teknolojilerinin geliştirilmesi gibi problemlerin üstesinden gelmek için çevresel yönetim gereklidir (Arabi vd., 2014). Enerji üretimi sırasında karbondioksit emisyonları gibi istenmeyen çıktılar üretilmektedir. Dolayısıyla, sadece yöneticiler değil aynı zamanda enerji araştırmacıları ve politikacılar da sera gazı emisyonlarını azaltmaya yönelik stratejileri geliştirmeyi hedeflemiştir (Tietenberg ve Lewis, 2004). Böylelikle, daha az sayıda girdi ve istenmeyen çıktı elde etmek için, kuruluşlar çevresel verimlilik derecelerini ölçebilir ve geliştirebilirler (Hansen, 1996). Çevresel verimliliğin iyileştirilmesini sağlamak ve çevre verimliliğini artırmak için politikacılar ve araştırmacılar tarafından yenilenebilir enerji vurgulanmaktadır. Uluslararası Enerji Ajansı'na (IEA) göre, toplam enerji içerisinde yenilenebilir enerjilerinin payı artacak ve yenilenebilir enerji teknolojileri rekabetçi fiyatlarla geliştirilecektir. Sadece enerji kurumları değil, aynı zamanda hükümetler de üretim maliyetini azaltmak için yenilenebilir enerji teknolojisini desteklemeye devam etmektedir. Bu çerçevede, bu çalışma yenilenebilir enerji kaynaklarından üretilen elektrik enerjisi verimliliğini, 2006 ve 2015 yılları arasında araştırmak için yapılmıştır.

2.YÖNTEM

Charnes ve arkadaşlarının (1978) veri zarflama analizi (VZA) modeli, karar verme birimlerinin (KVB) her bir üyesi için göreceli bir etkinlik puanının değerlendirilmesine yönelik bir metodoloji sağlar. Charnes, Cooper ve Rhodes (1978)'in sabit getiri (CRS) modeli Banker ve arkadaşları (1984) tarafından ölçeğe göre değişken getirileri (VRS) içerecek şekilde genişletildi. VZA literatüründeki önemli bir problem, VZA modeli tarafından etkin olduğu düşünülen KVB'lerin, hepsinin etkinlik skorunun 1 değerine sahip olmasıdır. Sıralama problemine alternatif bir yaklaşım, Andersen ve Petersen'in (1993) süper etkinlik modeli tarafından sağlanmıştır ve çeşitli alanlarda kullanılmıştır. Süper etkinlik modeli,

standart VZA modellerinin (CRS veya VRS) uygulanmasını içerir, ancak değerlendirilmekte olan KVB'nin referans setinden çıkarıldığı varsayımı altındadır. Spesifik olarak, girdi yönelimli modeldeki süper etkinlik skoru, kalan KVB'ler tarafından oluşturulan sınıra göre söz konusu KVB'nin etkin durumuna zarar vermeden gerçekleşebilecek bir KVB'nin girdilerinde orantılı bir artış sağlar. Süper etkinlik puanı ayrıca bir kararlılık ölçüsü olarak da düşünülebilir. Diğer bir deyişle, eğer girdi verileri zaman içinde hataya veya değişime maruz kalırsa, süper etkinlik puanı, söz konusu değişikliklerin KVB'nin durumunu etkin bir birim olarak ihlal etmeden ne kadarının ortaya çıkabileceğini değerlendirmenin bir yolunu sunar.

Bazı koşullar altında, süper etkinlik VZA modelinin etkin KVB'ler için uygun çözümlere sahip olamayabileceği iyi bilinmektedir (Zhu, 1996; Dula ve Hickman, 1997; Seiford ve Zhu, 1998, 1999). Süper etkinlik kavramının geniş kullanımı göz önüne alındığında, bu olanaksızlık probleminin üstesinden gelebilecek yaklaşımlar geliştirmek faydalı olacaktır. Çalışmada, süper etkinlik modelinde olanaksızlık problemini çözmek için çeşitli yaklaşımlar (modifiyeli girdi yönlü ve modifiyeli çıktı yönlü modeller) ele alınmıştır. Yaklaşım, fizibilite varken VRS süper verimlilik modelinden kaynaklananlara eşdeğer VRS süper verimlilik puanları sağlar. VRS süper etkinlik modeli olanaksız olduğunda, yaklaşımda kalan KVB'ler tarafından oluşturulan (sanal) bir referans KVB belirler ve girdi ve çıktılardaki süper etkinliği karakterize eden bir puan verir. Süper etkinlik ve standart DEA modelleri her zaman uygulanabilir çözümlere sahip olduğundan ve etkin olmayan KVB'ler için eşit sonuçlar verdiğinden, mevcut çalışma değerlendirme altındaki bir KVB'nin verimli olduğunu varsaymaktadır.

n tane karar verme birimi olduğunu varsayalım. $\{KVB_j : j=1,2,\dots,n\}$ her j. KVB s tane çıktıya y_{rj} ($r=1,2,\dots,s$) ve m tane girdiye x_{ij} ($i=1,2,\dots,m$) sahip olsun. Bu durumda, sırasıyla ölçeğe göre sabit getiri varsayımına dayanan girdi yönlü ve çıktı yönlü radyal süper etkinlik modelleri Eşitlik 2.1 ve Eşitlik 2.2'de verilmiştir. Ölçeğe göre sabit getiri varsayımına dayanan CRS modelinde süper etkinlik ve standart etkinlik modelleri arasındaki tek fark $j \neq k$ kısıtının modele eklenmesidir. Yani, değerlendirilen KVB referans kümeden çıkartılmıştır.

2.1.Girdi Yönlü Radyal Süper Etkinlik Modeli

$$\min \rho_{SE} = 1 + \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m s_i^- / x_{ik}$$

$$s.t. \quad \sum_{j=1, j \neq k}^n x_{ij} \lambda_j - s_i^- \leq x_{ik}$$

$$\sum_{j=1, j \neq k}^n y_{rj} \lambda_j \geq y_{rk}$$

$$\sum_{j=1, j \neq k}^n y_{rj} \lambda_j \geq y_{rk}$$

$$\lambda, s^-, s^+ \geq 0$$

$$i = 1, 2, \dots, m; \quad r = 1, 2, \dots, q; \quad j = 1, 2, \dots, n \quad (j \neq k)$$

(2.1)

2.2.Çıktı Yönlü Radyal Süper Etkinlik Modeli

$$\min \rho_{SE} = \frac{1}{1 - \frac{1}{s} \sum_{r=1}^s s_r^+ / y_{rk}}$$

$$s. t. \quad \sum_{j=1, j \neq k}^n x_{ij} \lambda_j \leq x_{ik}$$

$$\sum_{j=1, j \neq k}^n y_{rj} \lambda_j + s_r^+ \geq y_{rk}$$

$$\lambda, s^-, s^+ \geq 0$$

$$i = 1, 2, \dots, m; \quad r = 1, 2, \dots, q; \quad j = 1, 2, \dots, n \quad (j \neq k) \quad (2.2.)$$

Girdi yönlü ve çıktı yönlü veri zarflama analizi modellerinde uygunsuz çözüm durumları mevcut olabilir. Böyle durumlarda girdi veya çıktı yönlü modeller modifiye edilmelidir. Tablo 2.1’de standart ve süper etkinlik modellerinin girdi yönlü, modifiyeli girdi yönlü, çıktı yönlü ve modifiyeli çıktı yönlü modelleri için amaç fonksiyonları ve etkinlik skorları gösterilmektedir. Pek çok bilim adamı çalışmalarında bu problemi ele almış ve çeşitli çözüm önerileri sunmuşlardır. Seiford ve Zhu (1999), radyal süper etkinlik VRS, NIRS ve NDRS modellerinin uygunsuz çözüm probleminin kapsamlı analizini gerçekleştirdi. Girdi ve çıktı yönlü radyal süper etkinlik modellerin uygunsuz çözümünün nedenleri, uzaklık fonksiyonu kullanan süper etkinlik modelleri ve SBM süper etkinlik modeller için de geçerlidir.

Tablo 2.1. Standart ve Modifiyeli Süper Etkinlik Modelleri

| Durum | Model | Standart Etkinlik Modeli | | | | Süper Etkinlik Modeli | | | |
|-------|------------------------|--------------------------|---------------|--|-------------------------|-----------------------|---------------|--|-------------------------|
| | | w^I | w^O | Amaç Fonksiyonu | Etkinlik Skoru | w^I | w^O | Amaç Fonksiyonu | Etkinlik Skoru |
| 1 | Girdi Yönlü | 1 | 0 | $1 - \alpha$ | $1 - \alpha^*$ | 1 | 0 | $1 - \alpha$ | $1 - \alpha^*$ |
| 2 | Modifiyeli Girdi Yönlü | 1 | ε | $\frac{1 - \alpha}{1 + \varepsilon \beta}$ | $1 - \alpha^*$ | ε | 1 | $\frac{1 - \varepsilon \alpha}{1 + \beta}$ | $1 - \alpha^*$ |
| 3 | Çıktı Yönlü | 0 | 1 | $\frac{1}{1 + \beta}$ | $\frac{1}{1 + \beta^*}$ | 0 | 1 | $\frac{1}{1 + \beta}$ | $\frac{1}{1 + \beta^*}$ |
| 4 | Modifiyeli Çıktı Yönlü | ε | 1 | $\frac{1 - \varepsilon \alpha}{1 + \beta}$ | $\frac{1}{1 + \beta^*}$ | 1 | ε | $\frac{1 - \alpha}{1 + \varepsilon \beta}$ | $\frac{1}{1 + \beta^*}$ |

Tablo 2.1’de geliştirilmiş modelin dört özel durumu ve süper etkinlik modeli için tanımları listelenmiştir. Durum 1, geleneksel girdi odaklı modelin eşdeğeridir ve durum 2, girdi yönünü korurken olanaksızlık sorununu aşan modifiyeli girdi odaklı modeldir. Durum 3, geleneksel çıktı odaklı modelin eşdeğeridir ve durum 4, çıktı yönelimini korurken uygulanabilirlik sorununu aşan modifiyeli çıktı odaklı modeldir. w^I ve w^O değerleri modelin yönünü belirtir. Geliştirilmiş süper etkinlik modeli, w^I ve w^O sıfır olmayan değerlere sahip olduğunda her zaman uygulanabilir. Etkinlik skorlarında kullanılan $(1 - \alpha^*)$ girdinin minimize edilmesini ve $(1 + \beta^*)$ ise çıktının maksimize edilmesini amaçlamaktadır.

3.UYGULAMA

Çalışma, 2006 – 2015 yılları arasında Türkiye’de yenilenebilir enerji etkinliğinin hangi yıllarda etkin olup olmadığını incelemeyi amaçlamıştır. Çalışmada kullanılan girdiler hidrolik kurulu gücü, jeotermal kurulu gücü, rüzgâr kurulu gücü, güneş kurulu gücü ve biyokütle kurulu gücü iken çıktı yenilenebilir enerjisinden üretilen elektriktir. Girdi ve çıktı değişkenlerine ait veriseti Tablo 3.1.’de ve analiz sonuçları Tablo 3.2’de verilmiştir. Analiz sonuçları incelendiğinde, girdi yönlü CCR ve çıktı yönlü BCC modellerinde etkinlik skoru 1 olan yıllar etkindir. Uygunsuz çözümlerin ortadan kaldırılması için kullanılan modifiyeli girdi ve modifiyeli çıktı değerlerinin sonuçlarının yorumlanması klasik süper etkinlik modellerinin yorumlanması ile aynıdır. Dolayısıyla etkinlik skorları arasından en yüksek skora sahip olan yıl modifiyeli girdi yönlü model için 2008 ve modifiyeli çıktı yönlü model için ise 2007 yılıdır.

Tablo 3.1. Çalışmada Kullanılan Veriseti

| Karar Verme Birimi | Hidrolik kurulu gücü | Jeotermal kurulu gücü | Rüzgar kurulu gücü | Güneş kurulu gücü | Biyokütle kurulu gücü | Elektrik Enerjisi Üretimi |
|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|-------------------|-----------------------|---------------------------|
| 2006 | 13062,7 | 81,9 | 0,0 | 0,0 | 41,3 | 176.299,8 |
| 2007 | 13394,9 | 169,2 | 0,0 | 0,0 | 42,7 | 191.558,1 |
| 2008 | 13828,7 | 29,8 | 363,7 | 0,0 | 59,7 | 198.418,0 |
| 2009 | 14553,3 | 77,2 | 791,6 | 0,0 | 86,5 | 194.812,9 |
| 2010 | 15831,2 | 94,2 | 1320,2 | 0,0 | 107,2 | 211.207,7 |
| 2011 | 17137,1 | 114,2 | 1728,7 | 0,0 | 125,7 | 229.395,1 |
| 2012 | 19609,4 | 162,2 | 2260,6 | 0,0 | 168,8 | 239.496,8 |
| 2013 | 22289,0 | 310,8 | 2759,7 | 0,0 | 235,0 | 240.154,0 |
| 2014 | 23643,2 | 404,9 | 3629,7 | 40,2 | 299,1 | 251.962,8 |
| 2015 | 25867,8 | 623,9 | 4503,2 | 248,8 | 370,1 | 261.783,3 |

Tablo 3.2. Analiz Sonuçları

| Yıllar | Girdi Yönlü | | Çıktı Yönlü | |
|--------|-------------|----------------|-------------|----------------|
| | CCR | Modifiyeli CCR | BCC | Modifiyeli BCC |
| 2006 | 1,0000 | 1,9014 | 1,0000 | 1,0000 |
| 2007 | 1,0000 | 1,0865 | 1,0000 | 1,0865 |
| 2008 | 1,0000 | 2,6385 | 1,0000 | 1,0185 |
| 2009 | 0,9494 | 0,9494 | 0,9494 | 0,9494 |
| 2010 | 0,9726 | 0,9726 | 0,9726 | 0,9726 |
| 2011 | 1,0000 | 1,0336 | 1,0000 | 1,0336 |
| 2012 | 1,0000 | 1,0322 | 1,0000 | 1,0322 |
| 2013 | 1,0000 | 1,0027 | 1,0000 | 1,0027 |
| 2014 | 0,7427 | 0,7427 | 1,0000 | 1,0342 |
| 2015 | 0,7053 | 0,7053 | 1,0000 | 1,0390 |

4.SONUÇ

Çalışmada 2006 yılı ile 2015 yılları arasında yenilenebilir enerjiden üretilen elektrik enerjisi miktarının etkinliği araştırılmıştır. Ülkemizde mevcut bulunan yenilenebilir enerji kaynaklarından hangi yıllarda etkin bir şekilde elektrik enerjisi üretilmiştir sorusuna cevap aranmaya çalışılmıştır.

Yenilenebilir enerji kaynakları ve bu kaynaklar kullanılarak üretilen elektrik enerjisi maddi ve çevresel faydalarından dolayı tüm dünyada gittikçe artan bir öneme sahiptir. Ayrıca, enerji aynı zamanda küresel bir sorundur. Gelişmekte olan ülkeler sanayileşme oranları arttıkça daha fazla enerji tüketmektedirler. Türkiye bulunduğu coğrafi yapı sebebiyle ve içinde bulundurduğu enerji kaynakları göz önüne alındığında zengin bir ülkedir. Enerjinin kesintisiz ve güvenilir bir şekilde değerlendirilmesi ve ülkesel kalkınmanın enerjiden kaynaklanan sorunlardan fazla etkilenmemesi için Türkiye'nin yenilenebilir enerji kaynaklarını daha geniş çerçevede ele alması gerekmektedir.

KAYNAKLAR

- Andersen, P., & Petersen, N. C. (1993). A procedure for ranking efficient units in data envelopment analysis. *Management science*, 39(10): 1261-1264.
- Arabi, B., Munisamy, S., Emrouznejad, A., & Shadman, F. (2014). Power industry restructuring and eco-efficiency changes: A new slacks-based model in Malmquist–Luenberger Index measurement. *Energy Policy*, 68: 132-145.
- Banker, R. D., Charnes, A., & Cooper, W. W. (1984). Some models for estimating technical and scale inefficiencies in data envelopment analysis. *Management science*, 30(9): 1078-1092.
- Charnes, A., Cooper, W. W., & Rhodes, E. (1978). Measuring the efficiency of decision making units. *European journal of operational research*, 2(6): 429-444.
- Dula, J. H., & Hickman, B. L. (1997). Effects of excluding the column being scored from the DEA envelopment LP technology matrix. *Journal of the Operational Research Society*, 48(10): 1001-1012.
- Hansen, U. (1996). Restructuring the East German energy system. *Energy Policy*, 24(6): 553-562.
- IEA. World energy outlook. IEA; 2013.
- Seiford, L. M., & Zhu, J. (1998) “Stability Regions for Maintaining Efficiency in Data Envelopment Analysis”, *European Journal of Operational Research*, 108(1): 127-139.
- Seiford, L. M., & Zhu, J. (1999) “Infeasibility of Super-Efficiency Data Envelopment Analysis Models”, *INFOR: Information Systems and Operational Research*, 37(2): 174-187.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Tietenberg, T. H., & Lewis, L. (2004) “Environmental Economics and Policy”, Boston: Pearson Addison Wesley.

Zhu, J. (1996) “Robustness of the Efficient DMUs in Data Envelopment Analysis”, European Journal of Operational Research, 90(3): 451-460.



**“KIRILGAN SEKİZLİ” ARASINDA FİNANSAL KOMŞULUK İLİŞKİSİNİN
BELİRLEYENLERİ**

Sinem ATICI USTALAR*
Ramazan EKİNCİ**
Hakan KAHYAOĞLU***

ÖZET

Çalışmanın amacı farklı coğrafyada yer alan “Kırılğan Sekizli” olarak tanımlanan ülkeler arasında finansal açıdan, belirlenen iktisadi değişkenlere göre bir komşuluk ilişkisinin varlığını araştırmaktır. Bu açıdan finansal komşuluk ilişkisinin varlığına yönelik analizde; ülkelerin hisse senetleri piyasaları arasındaki mekânsal ilişki söz konusu iktisadi değişkenlere göre tahmin edilmiştir. Bu amaçla soyut uzayda (hypotetical space) ülkeler arasındaki yakınlığı tanımlamak için, karşılıklı ithalat, karşılıklı doğrudan yabancı yatırımlar, enflasyon oranları ve coğrafi uzaklık olmak üzere dört faktör kullanılmıştır. Sekiz ülkenin finansal piyasaları arasındaki mekânsal bağımlılık 2000-2015 yılları için Mekânsal Gecikme Modeli (Spatial Autoregressive Model-SAR) kullanılarak analiz edilmiştir. Bu teknikte, söz konusu ülkelere ait finansal piyasalar arasında bir komşuluk ilişkisinin varlığını sınamak için oluşturulan ağırlık matrisi, belirlenen iktisadi faktörler kullanılarak hesaplanan oranlara göre oluşturulmuştur. Böylece söz konusu bu ağırlık matrisi, “Kırılğan Sekizli” olarak tanımlanan ülkeler arasında iktisadi faktörlere göre bir komşuluk ilişkisinin oluşumu hakkında bulgu sunmaktadır. Analiz sonuçları, enflasyon ve coğrafi uzaklık faktörlerinin “Kırılğan Sekizli” ülkelerinin finansal piyasaları arasındaki birlikte hareketini açıkladığını, başka bir ifadeyle “Kırılğan Sekizli” ülkelerinin söz konusu iki faktör açısından finansal piyasaları arasında bir komşuluk ilişkisinin varlığını göstermektedir.

Anahtar Kelimeler: *Hisse Senedi Getirileri, Ağırlık Faktörleri, Mekânsal Ekonometri, Kırılğan Sekizli, Uluslararası Finansal Piyasalar*

Jel Kodları: *G15, C23, F39*

* Dokuz Eylül Üniversitesi, DEU İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dokuzçesmeler Kampüsü, İzmir, Türkiye, sinem.atustalar@gmail.com

** Dokuz Eylül Üniversitesi, DEU İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dokuzçesmeler Kampüsü, İzmir, Türkiye, ramazanekinci48@gmail.com

*** Dokuz Eylül Üniversitesi, DEU İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dokuzçesmeler Kampüsü, İzmir, Türkiye, hakan.kahyaoglu@gmail.com

**THE DETERMINANTS OF THE FINANCIAL NEIGHBOUR RELATIONS BETWEEN THE
“FRAGILE EIGHT”**

ABSTRACT

The aim of this study is to investigate the existence of a neighborhood relations among the countries which defined as “Fragile Eight” in different geography in terms of determined economic variables. In this respect, in the analysis of the existence of the financial neighborhood relations; the spatial relationship among the countries' equity markets is estimated according to the economic variables. For this purpose, four factors including bilateral import, bilateral foreign direct investments, inflation rates and geographical distance were used to define the proximity between countries in hypothetical space. The spatial dependence among the financial markets of eight countries was analyzed using the Spatial Autoregressive Model (SAR) for the years 2000-2015. In this technique, the weight matrix created to test the existence of a neighborhood relations among the financial markets of the countries in question was created according to the calculated ratios by using the determined economic factors. Thus, this weight matrix presents the finding of the formation of a neighborhood relations among the countries which are defined as “Fragile Eight” according to the economic factors. The results of the analysis show that the inflation and the geographical distance factors explain the coexistence among financial markets of the “Fragile Eight” countries, in other words, the existence of a neighborhood relations among the financial markets of the “Fragile Eight” countries in terms of the two factors.

Keywords: *Stock Returns, Weight Factors, Spatial Econometrics, Fragile Eight, International Financial Markets*

Jel Codes: *G15, C23, F39.*

1.GİRİŞ

Uluslararası Sermaye Varlıkları Fiyatlama Modeli, finansal piyasa aktörlerinin uluslararası finansal piyasalarda işlem yaparak portföylerini çeşitlendirebileceklerinin ve böylece portföy risklerini minimize edebileceklerinin teorik temellerini atmıştır. Portföy risklerini minimize etmek isteyen yatırımcı, uluslararası finansal piyasalarda işlem yaparken hangi finansal piyasaların birlikte hareket ettiğini ve hangi finansal piyasaların dışsal şoklardan daha fazla etkilendiğini bilmek istemektedir. Özellikle 2008 küresel finans kriziyle birlikte farklı ülkelerin finansal piyasaları arasında bir bağımlılığın (eşzamanlı hareket etme eğiliminin) ortaya çıktığı

görülmüştür (Aloui ve diğerleri, 2011). Bu doğrultuda, hangi ekonomik yapı altında bir ülkenin finansal piyasasında ortaya çıkan bir şokun diğer ülkelerin finansal piyasalarına da yayıldığını analiz etmek önem kazanmaktadır.

Literatürde ülkeler arasındaki ekonomik ilişkileri mekânsal bir yaklaşımla analiz eden çok sayıda çalışma olmasına karşın²⁷, uluslararası finansal piyasalar arasındaki ilişkileri mekânsal bağlamda ele alan çalışmalar oldukça kısıtlıdır²⁸. Literatürde komşuluk ilişkisi daha çok “Öklidiyen” anlamda bir uzaklık tanımına bağlı olarak ifade edilmektedir ve teorik bağlamda çekim modeli komşuluk ilişkilerini analiz etmede yaygın olarak kullanılan bir modeldir. Bu bağlamda, finansal piyasalarda komşuluk ilişkisi de daha çok çekim modeli çerçevesinde ele alınmıştır. Bu yaklaşıma göre, ülkeler arasındaki coğrafi uzaklık azaldıkça hisse senedi piyasaları arasındaki bağımlılık artmaktadır.²⁹

Mekânsal ekonometrideki son gelişmeler, finansal piyasaların birlikte hareketini analiz etmek için uygun araçlar sağlamıştır. Özellikle, çekim modelinin aksine, söz konusu mekânsal yaklaşımlar soyut uzayda (hypotetical space) ülkeler arasında farklı iktisadi değişkenlere göre mesafe tanımlanmasına olanak tanımaktadır (Asgharian ve diğerleri, 2013). Başka bir ifadeyle, Mekânsal ekonometrik yaklaşımlar komşuluk ilişkisini “Hilbertyen” anlamda bir uzaklık tanımına bağlı olarak ifade edilmesini sağlamaktadırlar. Bu bağlamda, Asgharian ve diğerleri (2013) farklı iktisadi değişkenler üzerinden bir komşuluk tanımlaması yaparak, ülkelerin hisse senedi piyasa getirileri arasında mekânsal bir bağımlılığın olduğunu ortaya koymuşlardır. Blasques ve diğerleri (2014) Avrupa bölgesi ülkeleri arasında CDS primlerine göre bir mesafe tanımlamışlar ve bu bölge ülkeleri için borç ilişkilerinin bir şok yayılım kanalı olduğu sonucuna ulaşmışlardır.

Yukarıda bahsedilen literatür ile paralel olarak, çalışmamızda Kırılgan Sekizli ülkelerinin hisse senedi piyasalarını etkileyebilecek, enflasyon beklentilerinin yakınsaması, karşılıklı ticaret akımları, doğrudan yabancı yatırımlar ve coğrafi uzaklık olmak üzere dört adet farklı iktisadi değişken belirlenmiştir. Söz konusu potansiyel iktisadi değişkenlerden hangilerinin finansal anlamda bir komşuluk ilişkisi yarattığı mekânsal ekonometrik teknikler ile analiz edilmiştir. Analizimiz Arjantin, Brezilya, Şili, Hindistan, Endonezya, Güney Afrika, Rusya ve Türkiye'nin dâhil olduğu “Kırılgan Sekizli” ülkeleri olarak adlandırılan ülkelerin hisse senedi piyasa getirilerinin 2000- 2015 yılları için mekânsal analizini kapsamaktadır.

²⁷ Bakınız: Anselin, 1988, Cressie, 1991, Ertur v.d., 2006, Blonigen v.d., 2007, LeSage ve Pace, 2009, Baltagi ve Pirotte, 2011, Lopez ve Ascencio, 2017.

²⁸ Bakınız: Fernandez 2009, Arnold ve diğerleri 2011, Asgharian ve diğerleri 2013

²⁹ Bakınız: Flavin ve diğerleri 2002, Beine ve Candelon 2010, Wälti 2010.

Ampirik model sonuçlarımız, seçilen potansiyel iktisadi değişkenler arasından enflasyon beklentilerinin ve coğrafi uzaklığın Kırılgan Sekizli ülkelerinin hisse senedi piyasalarının eşzamanlı hareketini daha fazla etkileyen değişkenler olduğunu göstermektedir. Ayrıca analiz bulguları mekânsal ekonometrik yöntemlerin finansal verilerin analizi için de uygun yöntemler olduğunu göstermektedir.

Çalışmamızda izleyen bölümler şöyledir: 2. Bölüm'de analizde kullanılan mekânsal ekonometrik yöntem tanıtılacaktır. 3. Bölüm'de veri ve seçilen kontrol değişkenleri tanıtılacaktır. 4. Bölüm'de ampirik model bulguları irdelenecektir. Sonuncu bölüm olan 5. Bölüm ise sonuç bölümüdür.

2. YÖNTEM: MEKÂNSAL ETKİLER VE MODELLENMESİ

Mekânsal veri, mekânsal otokorelasyon ve mekânsal heterojenite olmak üzere iki temel bileşen tarafından belirlenmektedir (Anselin, 1988). Bu iki özelliğin bir araya gelmesi sonucu oluşan etki ise mekânsal etkiler olarak adlandırılmaktadır. Mekânsal bağımlılık, korelasyonsuz hata terimleri varsayımını çiğneyen ve coğrafi uzayda bulunan gözlemler arasındaki bağımlılığı ifade eden bir kavram olarak kullanılmaktadır. Mekânsal heterojenite ise, uzaylar arasında görülen bir davranışın sistematik değişimlerini ifade eder ve genellikle değişen varyanslı hata terimlerine yol açar (Can,1990, sy:256). Oluşturulan hipotezler ve verinin yapısına bağlı olarak, mekânsal etkiler farklı mekânsal yöntemlerle modellenmektedir. Bunlar arasında en yaygın kullanılan mekânsal gecikme ve mekânsal hata modelleridir. Bu bölümde çalışmanın ampirik bulgular kısmında yer alan mekânsal gecikme modeline ait açıklamalar yer almaktadır.

Mekânsal Gecikme Modeli:

Tobler (1979)'in coğrafyalar kanununa göre, “yakın şeyler” “uzak şeyler”e göre birbirleriyle daha ilişkilidir. Bu açıdan değerlendirildiğinde “yakın ve ilişkili şeyler” mekânsal modellemenin başlangıç noktasını oluşturmaktadır. Bu yakınlık uzaklık ilişkisinin tanımlanmasında kullanılan en yaygın mekânsal model tipi, mekânsal gecikme modeli (Spatial Autoregressive Model- SAR) olup, aşağıdaki şekilde ifade edilebilmektedir:

$$y = \rho W y + X \beta + u \quad (1)$$

Yukarıdaki eşitlikte y , $n \times 1$ boyutlu bağımlı değişkenler vektörünü; x , $n \times k$ boyutlu açıklayıcı değişkenler vektörünü; β $k \times 1$ boyutlu regresyon katsayılarını; u , $n \times 1$ boyutlu bağımsız ve özdeş dağılımlı rassal hataları ve W , $n \times n$ boyutlu dışsal mekânsal ağırlıklar matrisini göstermektedir. Birbiriyle etkileşimi olan gözlemler ağırlık matrisinde sıfır olmayan değerlerle, etkileşim halinde olmayan gözlemler ise sıfır olan değerlerle tanımlanmaktadır. $W y$, farklı mekânsal ilişkileri modellemek amacıyla modele dâhil edilen mekânsal gecikmeli bağımsız

değişkeni göstermektedir. p katsayısı ise, mekânsal otokorelasyon veya mekânsal bağımlılık parametresi olarak ifade edilmektedir (Wall, 2004). $p = 0$ değerini aldığıında, (1) nolu eşitlikteki model standart doğrusal modele dönüşmektedir. Bu durumda p , komşuluk veya etkileşim içinde olan birimler arasındaki bağımlılığın ölçüsünü göstermektedir. Eğer varsayılan mekânsal yapı, mevcut mekânsal bağımlılığın iyi bir göstergesi değilse, tahmin edilen p parametresi çok düşük veya anlamsız olacaktır.

3. VERİ

“Kırılğan Sekizli” ülkelerinin finansal piyasalarının birbirlerine olan göreceli uzaklığı, dört faktör kullanılarak belirlenmiştir. Bu faktörler; ülkelerin beklenen enflasyon oranları arasındaki mutlak fark, coğrafi uzaklık, karşılıklı ithalat ve doğrudan yabancı yatırım akımlarıdır. Söz konusu faktörler, coğrafi uzaklık faktörü hariç, zamana göre değişen faktörlerdir. Dolayısıyla, “Kırılğan Sekizli” olarak adlandırılan ülkelerin finansal piyasaları arasındaki komşuluk ilişkisini temsil eden ağırlık matrisleri de zamana göre değişmektedir. İlk bakışta, söz konusu faktörlerin doğrudan hisse senedi piyasaları ile ilişkili olmadığı görülse de, analizin amacı hangi karşılıklı değişkenlerin finansal piyasalar arasında bir mesafe yaratıp yaratmadığının belirlenmesidir.

3.1. Beklenen Enflasyon Oranları Arasındaki Mutlak Fark

Uluslararası yatırımcılar yerel piyasa enflasyonundaki artıştan dolayı kaynaklanan tüketim riskinden korunmak için, yerli finansal piyasalarda işlem yapma eğilimindedirler. Eğer iki ülke arasındaki enflasyon oranları farkı artarsa, yatırımcılar yerel piyasadaki enflasyon riskini yabancı finansal varlıklarla gideremeyeceği için yerli finansal varlıkları tercih edeceklerdir. Dolayısıyla iki ülkenin enflasyon oranları birbirlerine ne kadar yakınsarsa, yerel yatırım taraflılığı (home bias) o kadar düşük olacaktır. Ayrıca, iki ülkenin enflasyon beklentilerinin birbirine yakınsaması, istikrarlı bir kur düzeyi anlamına gelmekle birlikte iki ülke arasındaki karşılıklı hisse senedi yatırımlarının da artmasına neden olabilmektedir (Asgharian ve diğerleri, 2013, 11).

Analizimizde beklenen enflasyon serisi Dinamik IS-LM analizi çerçevesinde Yeni Keynesyen Phillips Eğrisi dikkate alınarak ve serinin bir Martingale süreç olduğu varsayılarak gelecek dönemdeki beklenen enflasyonun cari dönemde gerçekleşen enflasyon oranına eşit olacak şekilde oluşturulmuştur. Daha sonra, finansal piyasalar arasında karşılıklı bir faktörü temsil etmesi için, ülkelerin beklenen enflasyon oranlarının mutlak olarak farkı alınmıştır.

3.2. Karşılıklı Ticaret Akımları

Literatürde karşılıklı ticaret akımlarının ülkelerin benzer konjonktür içinde hareket etmelerini güçlendirdiğinin yanı sıra hem riskten korunma kanalı (Rose ve Spiegel, 2004) hem de

bilgi kanalı (Portes ve Rey, 2005) olarak ele alınmıştır. Ticaretin bir riskten korunma kanalı olduğuna dair yapılan ilk teorik çalışma olan Rose ve Spiegel (2004)'in çalışmalarına göre, banka kredileri ya da borçlanma kağıtları aracılığıyla borçlanmak isteyen bir ülkenin ticari bağları güçlü olan bir kreditor ülkeyi tercih etmektir. Çünkü mal ticareti bir bakıma güvence olarak görülmektedir. Bu bağlamda ülkeler arasındaki uluslararası ticaretin hacmi borç akımlarının hacmini de belirlemektedir.

Literatürde ticaretin finansal piyasalar için bir bilgi kanalı olduğu, daha sıkı ticaret bağları bulunan ülkelerin, ticaret sırasında belirli bir bilgi elde ettikleri, dolayısıyla ticari ilişkileri kuvvetli olan iki ülke arasındaki bilgi asimetrisinin azaldığı varsayımına dayanmaktadır. Bu konuda yapılan temel ampirik çalışmalardan Portes ve Rey (2005), çekim modelini kullanarak ülkeler arasındaki karşılıklı ticaret akımlarının, karşılıklı hisse senedi yatırımları üzerinde arttırıcı bir etkisinin olduğunu ve yatırımcıların hisse senedi yatırımlarında daha fazla ticaret yaptıkları ülkeleri tercih ettiklerini ortaya koymuşlardır. Bu bağlamda ticaret akımları hem bilgi hem de risk kanalı yoluyla uluslararası finansal yatırımlarda, yatırımcılar için belirleyici bir unsurdur.

3.3. Karşılıklı Doğrudan Yabancı Yatırımlar

Finansal piyasalar arasındaki mekânsal bağımlılığı temsil edebilecek diğer bir faktör olan karşılıklı doğrudan yabancı yatırımlar, uzun dönemde ülke çiftleri arasındaki ekonomik ilişkilerin istikrarlı olduğunun göstergelerinden biridir. Doğrudan yabancı yatırımların özelliklerine ilişkin teorik varsayımlar, finansal krizler sırasında bile, sermaye yatırımları için istikrarın ve uzun dönemli yatırım motivasyonunu sağladığını desteklemektedir (Lipsey, 2001). Literatürde doğrudan yabancı yatırımların finansal piyasalar üzerindeki etkisine yönelik sınırlı ampirik çalışma bulunmasına karşın, Arčabić ve diğerleri (2013) uzun dönemde karşılıklı doğrudan yabancı yatırımların hisse senedi piyasaları üzerindeki etkisinin ekonomik büyüme kanalıyla gerçekleştiğini ifade etmişlerdir.

3.4. Coğrafi Uzaklık

Birbirlerine coğrafi olarak yakın olan ülkelerin finansal piyasalarında işlem yapmak, ülkelerin hem yakın ekonomik ilişkilere hem de benzer iş çevrimlerine sahip olmaları dolayısıyla yatırımcı için bir avantaj oluşturmaktadır. Aynı zamanda, yatırımcı coğrafi olarak yakın olan piyasalar hakkında, daha uzak olan piyasalara nazaran, daha fazla enformasyona sahip olmaktadır. Dolayısıyla coğrafi yakınlık nedeniyle azalan asimetric bilgi sonucunda, yatırımcı kendi ülke finansal piyasasına daha yakın olan finansal piyasaları tercih etmekte ve coğrafi yakınlık karşılıklı finansal piyasalar arasındaki hisse senedi akımlarını hızlandırıcı bir etki yaratmaktadır. Portes ve Rey (2005)'e göre ülkeler arasındaki mesafe finansal piyasalarda bilgi

asimetrisi kanalıyla bir sürtünmeye neden olmaktadır. Ülkeler arasındaki coğrafi uzaklık arttığında, ülkeler arasındaki bilgi akışı azalmakta ve bilgi asimetrisi artmaktadır. Bununla birlikte ülkeler arasındaki coğrafi uzaklık arttıkça finansal varlık yatırımları azalmaktadır.

3.5. Kontrol Değişkenleri

Mekânsal bağımlılığının varlığına ilişkin kullanılan faktör dışında, modele açıklayıcı makro değişkenler olarak; büyüme oranlarındaki, beklenmeyen enflasyon oranlarındaki, döviz kurundaki değişim ve bir önceki dönem hisse senedi getirileri eklenmiştir.

GSMH büyüme oranı bir ülkenin ekonomik büyüklüğünün bir göstergesidir. Dolayısıyla büyüme oranı arz yönlü olarak bir ülkenin üretim kapasitesini gösterirken, talep yönlü olarak da bir ülkedeki potansiyel pazarı göstermektedir (Starck, 2012:5). Aynı zamanda GSMH büyüme oranı ülkenin iş çevrimleri aşamalarını temsil eden değişkenlerden biridir. Dolayısıyla büyüme oranlarının hisse senedi piyasaları üzerinde pozitif etki yaratması beklenmektedir.

Beklenmeyen enflasyon oranının artması ekonominin canlanma döneminde olduğunu göstermektedir ve dolayısıyla, pozitif bir beklenmeyen enflasyonun hisse senedi getirileri üzerinde arttırıcı bir etki yaratacağı beklenebilir. Fakat Chen ve diğerleri (1986) beklenmeyen enflasyon oranlarının hisse senedi fiyatları üzerinde negatif yönde bir etkiye sahip olduğunu ortaya koymuşlardır. Analizimizde beklenmeyen enflasyon oranı, gerçekleşen enflasyon oranından beklenen enflasyon oranı düşürülerek hesaplanmıştır.

Döviz kurundaki pozitif değişim (yerli paranın değer kaybetmesi) hisse senedi getirileri üzerinde negatif yönde bir etki yaratmaktadır. Döviz kuru istikrarı aynı zamanda ekonomik istikrarın da bir göstergesi olduğundan, yerli paradaki değer kaybı yatırımcı için ülke ekonomisine dair negatif bir haber olduğundan hisse senedi yatırımları üzerinde azaltıcı bir etki yaratmaktadır. Literatürde döviz kuru değişiminin hisse senedi getirileri üzerindeki etkisi net olarak ortaya konulamamıştır. Gunasekarage ve diğerleri (2009), Güney Asya ülkeleri için döviz kuru ve hisse senedi getirileri arasında bir ilişkili bulamamışlar, fakat Zhao (2009) ise Çin için döviz kuru ve hisse senedi getirileri arasında pozitif yönde bir ilişkinin olduğunu ortaya koymuştur.

Geçmiş dönem hisse senedi akımları hem bir bilgi kanalı olarak hem de yatırım davranışındaki istikrarı (persistence) göstererek hisse senedi yatırımlarını etkilemektedir. Uluslararası yatırımcı bir dönem önce hisse senedi yatırımı yaptığı finansal piyasa hakkında daha fazla bilgiye sahip olmakta ve bir dönem sonra tekrar aynı ülkeye yatırım yapma eğilimi, başka bir ifadeyle yatırım davranışında istikrarlı (persistence) davranma eğilimi göstermektedir. Chitu ve diğerleri (2012) hisse senedi yatırımlarında histeri etkisini çekim modeli ile analiz etmişlerdir. Modele, 1943 yılı hisse senedi akımlarını eklemişler ve analiz sonucu geçmiş dönem hisse senedi

yatırımlarının mevcut dönem hisse senedi yatırımları üzerinde arttırıcı bir etkisinin olduğunu ortaya koymuştur.

3.6. Veri Tabanı

Çalışmamız 2000-2015 yılları itibariyle “Kırılgan Sekizli” ülkelerinin finansal piyasaları arasındaki mekânsal bağımlılığın varlığını sınıamaktadır. Bu amaçla analizimiz “Kırılgan Sekizli” ülkeleri olarak adlandırılan; Arjantin, Brezilya, Şili, Rusya, Hindistan, Endonezya, Güney Afrika ve Türkiye ülkeleri olma üzere 8 hisse senedi piyasasını kapsamaktadır. Söz konusu 8 hisse senedi piyasası için mekânsal panel veri analizi yapılmıştır.

Hisse senedi piyasası getiri oranı verileri *Dünya Bankası'nın Global Financial Development veri tabanından* alınmıştır. Veri tabanında hisse senedi getiri oranları yıllık ortalama hisse senedi piyasa endeksinin büyüme oranını ifade etmektedir. Yıllık ortalama hisse senedi endeksi ise, Bloomberg’deki günlük ortalama hisse senedi piyasa endeksi dikkate alınarak oluşturulmuştur. Karşılıklı ithalat akımları verileri *IMF'in Direction of Trade Statistic (DOTS)* veri tabanından derlenmiştir. Bu veri tabanı IMF’ e üye olan ve olmayan tüm ülkelerin yıllık ithalat ve ihracat verilerini içermektedir. İthalat ve ihracat değerleri cari fiyatlarda ABD doları cinsinden ifade edilmektedir. Karşılıklı doğrudan yabancı yatırım verileri *IMF'in Coordinated Direct Investment Survey (CDIS)* veri tabanından elde edilmiştir. Veri tabanı ülkelerin doğrudan yabancı yatırım giriş ve çıkışlarına dair bir anket ile oluşturulmaktadır. Analizimizde doğrudan yabancı yatırım girişlerinin ve çıkışlarının toplamı alınarak kullanılmıştır. Ayrıca veri cari fiyatlarda ABD doları cinsinden ifade edilmektedir. Yıllık bazda kullanılan GSMH büyüme oranları, *Dünya Bankası* veri tabanından elde edilmiştir. Ülkeler arasındaki karşılıklı coğrafi uzaklık verileri *CEPII'nin Gravity Veri tabanından* kullanılmıştır. Enflasyon oranı ve döviz kuru verileri *Dünya Bankası'ndan* derlenmiştir. Döviz kuru verisi yerli paranın ABD doları cinsinden değerini ifade etmektedir.

4. AMPİRİK BULGULAR

Mekânsal Gecikme Modeli (SAR)’ne geçmeden önce analiz ülkelerinin finansal piyasaları arasında mekânsal bir bağımlılığın olup olmadığına yönelik belirleme testleri yapılmıştır. Belirleme testleri için Moran I Test İstatistiği, Hata LM testi (LM_{error}) ve Hata Gecikme testi (LM_{lag}) kullanılmıştır. Test sonuçları Tablo 1’den görülebilmektedir.

Tablo 1. Mekânsal Bağımlılık Test Sonuçları

| | Ağırlık Matrisleri | | | | | | | |
|-------------------------|-----------------------|----------|-----------------------|----------|-----------------------------|----------|-----------------------|----------|
| | Enflasyon Oranı | | Ticaret | | Doğrudan Yabancı Yatırımlar | | Coğrafi Uzaklık | |
| Hipotezler | Chi2(x ²) | Olasılık | Chi2(x ²) | Olasılık | Chi2(x ²) | Olasılık | Chi2(x ²) | Olasılık |
| <i>Global Moran MI</i> | 0.3175 | 0.0000 | 0.2881 | 0.0000 | 0.3428 | 0.0000 | 0.3531 | 0.0000 |
| <i>Hata LM testi</i> | 22.4479 | 0.0000 | 15.7074 | 0.0001 | 12.6130 | 0.0004 | 22.9310 | 0.0000 |
| <i>Gecikme LM testi</i> | 14.8324 | 0.0001 | 10.7632 | 0.0010 | 10.6351 | 0.0011 | 25.5468 | 0.0000 |

Tablo 1’de görülen test sonuçlarına göre, seçilen iktisadi değişkenlere göre oluşturulan ağırlık matrislerinin kullanıldığı modellerde, mekânsal bir bağımlılığın olmadığını test eden sıfır hipotezi reddedilmiştir. Başka bir ifadeyle, “Kırılğan Sekizli” ülkelerinin hisse senedi piyasaları arasında farklı iktisadi değişkenlere göre mekânsal bir bağımlılık vardır. Bu test sonuçları beklenen enflasyon oranı, ticaret, doğrudan yabancı yatırımlar ve coğrafi uzaklık değişkenlerinin ülkelerin hisse senedi piyasaları arasında potansiyel olarak finansal anlamda komşuluk ilişkisi yaratabileceğine dair bulgu sunmaktadırlar.

“Kırılğan Sekizli” ülkelerinin finansal piyasaları arasındaki şok yayılımının hangi potansiyel iktisadi değişkenler üzerinden gerçekleştiğini belirlemeye yönelik olan SAR (Mekânsal Gecikme Modeli) modeli sonuçları aşağıdaki tablolarda gösterilmiştir.

Tablo 2. Beklenen Enflasyon Değişkenine Göre Mekânsal Gecikme Modeli Tahmin Sonuçları

| BAĞIMLI DEĞİŞKEN: <i>Hisse Senedi Getirileri</i> _{i,t} | | | |
|---|-----------|---------------|----------|
| Bağımsız Değişkenler | Katsayı | Standart Hata | t-değeri |
| ρ | 0.0234** | 0.0231 | -0.00006 |
| <i>Döviz Kuru</i> | 0.3292** | 0.1355 | 0.0603 |
| <i>Beklenmeyen Enflasyon Oranı</i> | -1.2347* | 0.2413 | -1.7252 |
| <i>Büyüme Oranı</i> | 2.4319* | 0.6087 | 1.0767 |
| <i>Bir Önceki Dönem Hisse Senedi Getiri Oranı</i> | 0.1770*** | 0.0904 | -0.0129 |
| C | 19.4419* | 3.7155 | 11.9709 |
| R ² | 0.5359 | | |

Not: *, **, *** sırasıyla %1, %5 ve %10 önem düzeyinde anlamlılıkları göstermektedir.

Tablo 2, iki ülkenin hisse senedi piyasa getirileri arasında enflasyon değişkeni üzerinden bir mekânsal bağımlılığın varlığını sınavan tahmin sonuçlarını göstermektedir. Tahmin sonuçlarına göre, ρ , mekânsal korelasyon, parametresi pozitif ve istatistiki olarak anlamlıdır. Başka bir ifadeyle, i kaynak ve j de destinasyon ülke olmak üzere, eğer i ve j ülkelerinin enflasyon beklentileri birbirlerine yakınsıyorsa, j ülkesinin hisse senedi piyasa getirilerinde yaşanan bir şok, i ülkesindeki hisse senedi getiri oranlarını etkilemektedir. Kontrol değişkenleri ise istatistikî olarak anlamlıdır. i ülkesi hisse senedi getiri oranları üzerindeki en büyük etkinin büyüme oranı olduğu görülmektedir.

Tablo 3 karşılıklı ticaret faktörüne göre mekânsal bir bağımlılığın varlığına yönelik tahmin sonuçlarını göstermektedir.

Tablo 3. Ticaret Değişkenine Göre Mekânsal Gecikme Modeli Tahmin Sonuçları

| BAĞIMLI DEĞİŞKEN: <i>Hisse Senedi Getirileri_{i,t}</i> | | | |
|--|----------|---------------|----------|
| Bağımsız Değişkenler | Katsayı | Standart Hata | t-değeri |
| ρ | 0.0616 | 0.0214 | -0.0108 |
| <i>Döviz Kuru</i> | 0.3738** | 0.1404 | 0.0827 |
| <i>Beklenmeyen Enflasyon Oranı</i> | -1.1834* | 0.2575 | -1.7281 |
| <i>Büyüme Oranı</i> | 2.4594* | 0.6201 | 1.2071 |
| <i>Bir Önceki Dönem Hisse Senedi Getiri Oranı</i> | 0.1932** | 0.0880 | 0.0063 |
| C | 16.1214* | 3.7908 | 12.6749 |
| R ² | | 0.5325 | |

Not:*,**,*** sırasıyla %1, %5 ve %10 önem düzeyinde anlamlılıkları göstermektedir.

Tahmin sonuçlarına göre, ρ parametresinin istatistikî olarak anlamsız olduğu görülmektedir. i ve j ülkelerinin ticari bağlarının kuvvetli olması, iki ülkenin hisse senedi piyasaları arasında finansal anlamda bir komşuluk ilişkisi yaratmamaktadır. Kontrol değişkenlerine bakıldığında, hepsinin anlamlı olduğu görülmekle beraber i ülkesinde hisse senedi getiri oranlarının en fazla büyüme oranları tarafından pozitif yönde etkilendiği görülmektedir.

Tablo 4, model içindeki ağırlık matrisinin i ve j ülkeleri arasındaki karşılıklı doğrudan yabancı yatırımlara göre oluşturulduğu tahmin sonuçlarını göstermektedir.

Tablo 4. Doğrudan Yabancı Yatırım Değişkenine Göre Mekânsal Gecikme Modeli Tahmin Sonuçları

| BAĞIMLI DEĞİŞKEN: <i>Hisse Senedi Getirileri_{i,t}</i> | | | |
|--|----------|---------------|----------|
| Bağımsız Değişkenler | Katsayı | Standart Hata | t-değeri |
| ρ | 0.0857 | 0.0391 | -0.0131 |
| <i>Döviz Kuru</i> | 0.3426** | 0.1375 | 0.0841 |
| <i>Beklenmeyen Enflasyon Oranı</i> | -1.1319* | 0.2648 | -1.7389 |
| <i>Büyüme Oranı</i> | 2.4761* | 0.6345 | 1.2873 |
| <i>Bir Önceki Dönem Hisse Senedi Getiri Oranı</i> | 0.1993** | 0.0917 | 0.0055 |
| C | 16.8908* | 3.7742 | 12.5053 |
| R ² | | 0.5371 | |

Not:*,**,*** sırasıyla %1, %5 ve %10 önem düzeyinde anlamlılıkları göstermektedir.

Tablo 4'deki tahmin sonuçları incelendiğinde, mekânsal korelasyon parametresinin pozitif fakat istatistikî olarak anlamsız olduğu görülmektedir. i ve j ülkeleri arasında doğrudan yabancı yatırımların fazla olması, iki ülkenin hisse senedi piyasası getiri oranları arasında finansal anlamda bir mekânsal ilişki yaratmamaktadır. Başka bir ifadeyle, söz konusu analiz ülkeleri için doğrudan yabancı yatırım değişkeni bir şok yayılım kanalı değildir. Kontrol değişkenleri istatistikî olarak anlamlıdır. Buna göre, i ülkesinin büyüme oranı hisse senedi piyasa getirisi üzerinde pozitif yönde en büyük etkiye sahip olan değişkendir.

Tablo 5'de ise, i ve j ülkeleri arasındaki coğrafi uzaklık faktörüne göre iki ülkenin hisse senedi getiri oranları arasında mekânsal ilişkinin varlığına yönelik yapılan tahmin sonuçları yer almaktadır.

Tablo 5. Coğrafi Uzaklık Değişkenine Göre Mekânsal Gecikme Modeli Tahmin Sonuçları

| BAĞIMLI DEĞİŞKEN: <i>Hisse Senedi Getirileri_{i,t}</i> | | | |
|--|----------|---------------|----------|
| Bağımsız Değişkenler | Katsayı | Standart Hata | t-değeri |
| ρ | 0.0367* | 0.0288 | 0.0160 |
| <i>Döviz Kuru</i> | 0.3470** | 0.1368 | 0.0838 |
| <i>Beklenmeyen Enflasyon Oranı</i> | -1.2533* | 0.2456 | -1.6760 |
| <i>Büyüme Oranı</i> | 2.3950* | 0.6905 | 1.1230 |
| <i>Bir Önceki Dönem Hisse Senedi Getiri Oranı</i> | 0.1741** | 0.0903 | 0.0095 |
| <i>C</i> | 17.9325* | 3.5480 | 0.0160 |
| R^2 | | 0.5378 | |

Not:*,**,*** sırasıyla %1, %5 ve %10 önem düzeyinde anlamlılıkları göstermektedir.

Tahmin sonuçlarına göre, ρ parametresi pozitif ve istatistikî olarak anlamlıdır. i ve j ülkeleri arasındaki coğrafi uzaklık azaldıkça, j ülkesi hisse senedi piyasası getiri oranlarında meydana gelen bir şok i ülkesi hisse senedi piyasası getiri oranlarını da etkilemektedir. Başka bir ifadeyle, coğrafi uzaklık değişkeni iki ülkenin hisse senedi piyasaları arasında finansal bir komşuluk ilişkisi yaratmakta ve bir şok yayılım kanalı olarak işlev görmektedir.

5.SONUÇ

Çalışmamızda “Kırılgan Sekizli” olarak adlandırılan ülkelerin hisse senedi piyasaları arasındaki bağımlılığı etkileyen potansiyel kanalları ortaya koymak için mekânsal ekonometrik yöntemler kullanılmıştır. Çalışmamızda amaç, finansal piyasalar arasında toplam bağımlılığın derecesini ölçmek değil, finansal piyasalar arasında hangi potansiyel iktisadi kanalların bir bağımlılık yarattığını ortaya koymaktır. Analize konu olan ülkeler arasında soyut uzayda bir komşuluk tanımlayabilmek için, enflasyon beklentilerinin yakınsaması, karşılıklı ticaret, doğrudan yabancı yatırımlar ve coğrafi uzaklık olmak üzere dört potansiyel kanal belirlenmiştir.

Çalışmamızda kullanılan yöntem küresel finansal piyasaların eşzamanlı hareketini analiz etmede mekânsal ekonometrik tekniklerin kullanılabileceğini ve bu teknik yardımıyla farklı iktisadi değişkenlere göre soyut uzayda bir “mesafe” tanımlanabileceğini göstermektedir. Analiz bulgularına göre, enflasyon beklentilerinin yakınsaması ve coğrafi uzaklık değişkenleri “Kırılgan Sekizli” ülkelerinin finansal piyasaları arasındaki bağımlılığın potansiyel kanallarıdır. Analiz ülkelerinin enflasyon beklentileri birbirine yakınsadıkça, bir ülkenin hisse senedi getiri oranlarında yaşanan bir şok diğer ülkenin de hisse senedi getiri oranlarını etkilemektedir. Bu bağlamda, uluslararası finansal piyasalarda işlem yapan bir yatırımcı beklenen enflasyon oranları arasındaki mutlak farkın en düşük olduğu ülkelerin hisse senetlerini portföyünde bulundurursa portföy çeşitlendirmesinin avantajından daha fazla yararlanabilecektir. Coğrafi uzaklık değişkeni finansal piyasalar arasında komşuluk ilişkisi

yaratan diğer bir değişkendir. "Kırılgan Sekizli" ülkeleri arasındaki coğrafi uzaklığın azalması ülkelerin finansal piyasaları arasında şokların yayılmasına neden olmaktadır. Yatırımcı portföy riskini azaltabilmek için coğrafi olarak birbirine yakın olan ülkelerin hisse senetlerine yatırım yapmayı tercih ederse portföy riskinde daha etkin bir koruma sağlayabilecektir.

Çalışmamız mekânsal bir sistem içerisinde küresel finans piyasalarında şok yayılımının farklı iktisadi değişkenler kanalıyla gerçekleşebildiğini ve farklı coğrafyadaki finansal piyasalarda "komşuluk" tanımlamasının farklı iktisadi değişkenler üzerinden yapılabileceğini ortaya koymaktadır. Analizimiz bulgularına göre, kullanılan mekânsal yaklaşımın finansal piyasaların entegrasyon analizi ve bulaşma etkisi (contagion effect) analizleri için uygun bir yaklaşım olduğu ifade edilebilir.

KAYNAKÇA

- Aloui, R., Aïssa, M. ve Nguyen, D. (2011) "Global Financial Crisis, Extreme İnterdependences, and Contagion Effects: The Role of Economic Structure?", *Journal of Banking & Finance*, 35: 130–141.
- Anselin, L. (1988) "Spatial Econometrics: Methods and Models", Kluwer, Boston.
- ARČABIĆ, V., Globan, T. ve RAGUŽ, I. (2013) "The Relationship Between The Stock Market and Foreign Direct İntestment in Croatia: Evidence From VAR and Cointegration Analysis", *Financial Theory and Practice*, 37(1): 109-126.
- Arnold, M., Stahlberg, S. ve Wied, D. (2011) "Modelling Different Kinds of Spatial Dependence in Stock Returns", *Empirical Economics*, 44 (2): 761-774.
- Asgharian, H., Hess, W. ve Liu, L. (2013) "A Spatial Analysis of İnternational Stock Market Linkages", *The Knut Wicksell Centre for Financial Studies, Working Paper*, 3.
- Baltagi, B. ve Pirotte, A. (2011) "Seemingly unrelated regressions with spatial error components", *Empirical Economics*, 40(1): 5-49.
- Beine, M. ve Candelon, B. (2007) "Liberalization and Stock Market Comovement between Emerging Markets", *CESifo Working Paper*, 2131.
- Blonigen, B.A., Davies, R.B., Waddell, G.R. ve Naughton, H. T. (20017) "FDI in Space: Spatial Autoregressive Relationships in Foreign Direct İntestment", *European Economic Review* ,51: 1303–1325.
- Can, A. (1990) "The Measurement of Neighborhood Dynamics in Urban House Prices", *Economic Geography*, 66 (3): 254-272.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Chen, N., Roll, R. ve Ross, S.A. (1986) "Economic Forces and the Stock Market", *The Journal of Business*, 59(3): 383-403.
- Chitu, L., Eichengreen, B. ve Mehl, A.(2012) "History, Gravity and International Finance", *European Central Bank, Working Paper Series*, 1466.
- Cressie, N.A. (1991) "Statistic for Spatial Data", Wiley, New York.
- Ertur, C., Le Gallo, J. ve Baumont, C. (2006) "The European Regional Convergence Process, 1980-1995: Do Spatial Regimes and Spatial Dependence Matter?", *International Regional Science Review*, 29: 3-34.
- Fernandez, V. (2009) "Spatial Linkages in International Financial Markets", *Quantitative Finance*, 11 (2).
- Flavin, T. J., Hurley, M. J. ve Rousseau, F. (2002) "Explaining Stock Market Correlation: A Gravity Model Approach", *The Manchester School*, 70: 87-106.
- Gunasekarage, A., Pisedtasalasai, A. ve Power, D.M. (2004) "Macroeconomic Influence on the Stock Market: Evidence from and Emerging Market in South Asia", *Journal of Emerging Market Finance*, 3(3):285-304.
- LeSage, J. ve Pace, R. K. (2009) "Introduction to Spatial Econometrics" Boca Raton, Chapman &Hall/CRC.
- Lipsev, R. E. (2001) " Foreign Direct Investors in Three Financial Crises", *National Bureau of Economic Research, Working Paper*, 8084.
- López, M. V. ve Ascencio, F. L. (2017) "A Spatial Approach to the Link between Remittances and Regional Growth in Mexico", *Migraciones Internacionales*, 5 (3).
- Portes, R. ve Rey, H. (2005) "The Determinants of Cross-Border Equity Flows", *Journal of International Economics*, 65(2): 269-296.
- Rose, A. K. ve Spiegel, M. M. (2004) "A Gravity Model of Sovereign Lending: Trade, Default, and Credit" ,*IMF Staff Papers*, Palgrave Macmillan, 51(1): 50-63.
- Starck, S. C. (2012) "The Theoretical Foundation of Gravity Modeling: What are the developments that have brought gravity modeling into mainstream economics?", *Master Thesis*, Copenhagen Business School, Department of Economics, Denmark.
- Tobler, W. R. (1979) "Cellular Geography", *Philosophy in Geography*, Springer Netherlands: 379-386.
- Wall, M. M. (2004) " A Close Look at the Spatial Structure Implied by the CAR and SAR Models", *Journal of Statistical Planning and Inference*, 121(2): 311-324.

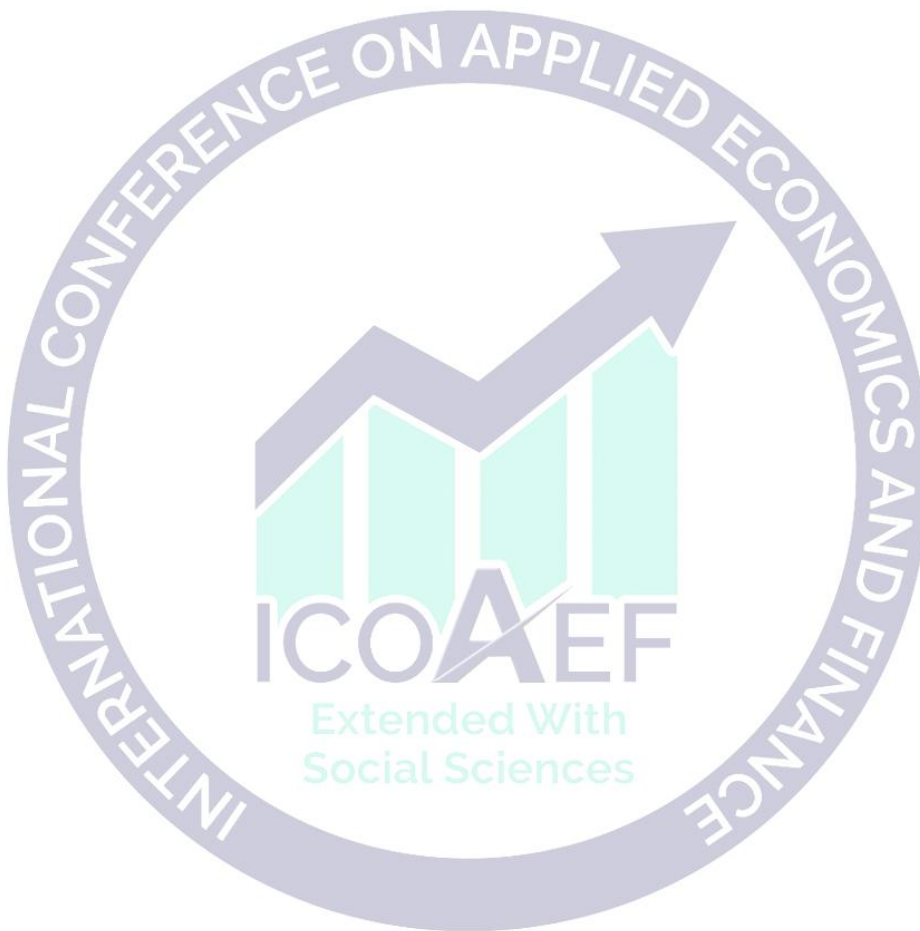
ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Wälti, S. (2010) "Stock Market Synchronization and Monetary Integration", *Journal of International Money and Finance*, 30: 96-110.

Zhao, H. (2010) "Dynamic Relationship Between Exchange Rate and Stock Price: Evidence from China", *Research in International Business and Finance*, 24(2): 103-112.



**YÖNETİM KURULUNDA CİNSİYET ÇEŞİTLİLİĞİ VE SÜRDÜRÜLEBİLİR RAPORLAMA
KALİTESİ ARASINDAKİ İLİŞKİ**

Dr. Öğr. Üyesi Şerife ÖNDER*

ÖZET

İşletmelerde kadınların yer aldığı yönetim kurullarının hem finansal performans hem de sosyal sorumluluklar üzerinde pozitif yönde bir etkisinin bulunduğuna yönelik bilimsel çalışmalar bulunmaktadır. Bu çalışmanın amacı, şirketlerin sürdürülebilir raporlama kalitesi üzerinde cinsiyet çeşitliliğinin etkisinin olup olmadığının ortaya konulmasıdır.

Araştırmada, 2012-2015 yılları arasında Borsa İstanbul'dan (BİST) 52 şirket/yıl verisi kullanılarak Dengeli Panel Veri Analizi Yöntemi uygulanmaktadır. İşletmelerin sürdürülebilir raporlama kalitesi, Küresel Raporlama Girişimi (Global Reporting Initiative-GRI) Standartlarına uygun olarak hazırladıkları sürdürülebilirlik raporları üzerinden ölçülmüştür. Yapılan analiz sonucunda, yönetim kurulunda cinsiyet çeşitliliğinin sürdürülebilir raporlama kalitesi üzerinde istatistiki açıdan anlamlı ve pozitif bir etkiye sahip olduğu tespit edilmiştir.

Elde edilen bulgular, kadınların yer aldığı yönetim kurullarının, şirketlerin sürdürülebilirlik performansını arttırdığını göstermektedir. Dolayısıyla şirketlerin en üst karar alma organı olan yönetim kurullarında kadın üye sayısının artırılması, şirketlerin sürdürülebilirlik performansının artmasını sağlayacaktır. Çalışma Türkiye'de yönetim kurullarında cinsiyet çeşitliliğinin sürdürülebilir raporlama kalitesine etkisi üzerine yapılan ilk çalışmalardan birisi olması açısından önem taşımaktadır.

Anahtar Kelimeler: *Raporlama Kalitesi, Cinsiyet Eşitliği, Sürdürülebilirlik, Yönetim Kurulu*

JEL Kodları: *M41, M14, M12*

**RELATIONSHIP BETWEEN BOARD GENDER DIVERSITY AND SUSTAINABILITY
REPORTING QUALITY**

ABSTRACT

There are scientific studies on the positive effect of the boards of directors on women in both financial performance and social responsibilities. The aim of this study is to determine whether the effects of gender diversity on sustainable reporting quality of firm.

* Dumlupınar Üniversitesi, Kütahya Sosyal Bilimler Meslek Yüksekokulu, Germiyan Kampüs, Kütahya/Merkez, Türkiye, serife.onder@dpu.edu.tr.

The research utilizes a Balanced Panel Data Analysis methodology using a sample of 52 firm-year observations from Borsa İstanbul (BİST) between the years 2012-2015. Sustainable reporting quality of the firm is measured by the sustainability reports they prepared in accordance with the Global Reporting Initiative (GRI) Standards.

As a result of the analysis, it was found that gender diversity on board has a statistically significant and positive effect on sustainable reporting quality. The findings show that the board of directors on women are increased the sustainability performance of enterprises. Therefore, increasing the number of women members in the board of directors, which is the highest decision-making body of the enterprises, will increase the sustainability performance of the firm. This study is one of the first studies on board gender diversity's effect on sustainability reporting quality in Turkey.

Keywords: Reporting Quality, Gender Equality, Sustainability, Board of Directors

JEL Codes: M41, M14, M12

1. GİRİŞ

Yönetim kurulu üyeleri, pay sahiplerinin çıkarları doğrultusunda hareket etmesini sağlamak için üst düzey yöneticilerin performansını ve faaliyetlerini izlemek ile sorumludur (O'connell ve Cramer, 2010: 387). Bu doğrultuda yönetim kurulu, şirket stratejilerini belirleme, önemli operasyonel ve finansal kararları onaylama gibi görev ve sorumlulukları olan en üst karar alma organıdır (Otluoğlu vd. 2016:749). Hem şirkette temsil probleminin aşılması hem de katılımcı menfaatlerinin korunması açısından iyi örgütlenmiş bir yönetim kurulu, “en iyi kurumsal yönetim mekanizması” olarak kabul edilmektedir (Aksoy, 2013: 47). Yönetim kurulunun bu çok yönlü görevleri layıkıyla yerine getirmesi, yönetim kurulunda yer alan üyelere bağlıdır.

Yönetim kurulu üyelerinin nitelikleri ve deneyimleri, şirket için doğru kararların alınmasında en önemli kriterdir. Ancak mükemmel ve benzer özelliklere sahip yönetim kurulu üyelerinin bir araya gelmesi, yönetim kurulunun en iyi kararları alması sonucunu doğurmuyor. En iyi kararların alındığı yönetim kurulları, farklı bakış açılarını bir araya getiren ve yetkinlikleri birbirlerini tamamlayan üyeler ile mümkün olmaktadır (IWD, 2018: 2). Bu durum literatürde yönetim kurulu çeşitliliği olarak adlandırılmaktadır. Yönetim kurulu üyelerinin yaş, cinsiyet, eğitim, etnik köken gibi özelliklerinin çeşitlilik arz etmesi olarak tanımlanmaktadır. Bu çalışmada, yönetim kurulu çeşitliliğinde cinsiyete odaklanılmıştır.

Yönetim kurullarında kadın üyelerin yer alması ile tamamı erkek üyelerden oluşan yönetim kurullarına göre farklı bakış açılarının oluşması ve daha bilinçli karar alınması sağlanmış olmaktadır. Yönetim kurullarında kadın üye sayısı arttıkça, kadınların karar verme üzerindeki etkisi de artacaktır (Ben-Amar vd. 2017: 372). Yapılan çalışmalarda kadınların erkeklere göre daha az gelenekçi, daha az

kuralcı, daha az hedonist ve daha sorgulayıcı oldukları, evrensel değerlere daha fazla sahip çıktıkları ve güvenliği daha çok önemsedikleri belirlenmiştir (IWD, 2018: 3).

Kadın yönetim kurulu üyeleri, karar alma sürecinde sağladıkları farklı perspektifleri ile şirket değerine pozitif katkı sağlamaktadır. (Karayel ve Doğan, 2014:76). Günümüzde şirket değeri sadece kârlılık gibi ekonomik değerler ile değil, çevresel ve sosyal değerler ile birlikte ölçülmektedir. Dolayısıyla çevreye ve topluma karşı olan sorumluluklarını yerine getirmeyen bir şirketin sürdürülebilir olması mümkün değildir. Şirketler çevreye ve topluma olan etkilerini finansal raporları ile birlikte raporlamaktadır. İşletmelerin çevresel ve sosyal sorumluluklarına ait bilgilerin yer aldığı bu raporlar “sosyal sorumluluk raporu”, “kurumsal sosyal sorumluluk raporu” veya “sürdürülebilirlik raporu” olarak adlandırılmaktadır. Türkiye’de şirketlerin sürdürülebilirlik raporlaması konusunda yasal bir düzenleme ile zorunluluk söz konusu değildir (Önder, 2018: 43). Dolayısıyla tamamen şirketin kurumsallık anlayışı ve etik bakış açısı ile alakalı olarak gönüllülük esasına dayalı olarak hazırlanmaktadır. Yapılan çalışmalarda şirketlerin etik davranışlarında, yönetim kurullarında yer alan kadın üyelerin oranının etkili olduğu ileri sürülmektedir (Al-Shaer ve Zaman, 2016: 210). Bu sebeple çalışmanın amacı Türkiye’de şirketlerin sürdürülebilir raporlama kalitesi üzerinde cinsiyet çeşitliliğinin etkisinin olup olmadığının ortaya konulmasıdır.

2. TÜRKİYE’DE YÖNETİM KURULLARINDA CİNSİYET ÇEŞİTLİLİĞİ

Kadınların yönetim kurulunda ve üst düzey yönetimde yer alma düzeyi ile ilgili düzenlemeler, genellikle ülkelerin kurumsal yönetim ilkelerinde ve raporlarında yer almaktadır. Avrupa Birliği (AB), üyelerine yönetim kurullarında kadın kotası koymasını isteyen bir direktif hazırlamıştır. Bunun sonucunda 12 AB üyesi ülke, kurumsal yönetim ilkelerine kadınların yönetim kurullarında temsilini arttırıcı hükümler eklemiştir. Yine 10 ülkede yönetim kurullarında kadınların yer almasını yasalarla düzenlemiştir. Amerika Birleşik Devletleri de şirketlerin yönetim kurullarında çeşitliliği sağlayacak politikaları geliştirmeleri ve bunları kamuya açıklamaları için zorunlu düzenlemeler gerçekleştirmiştir (Ararat ve Yurtoğlu, 2012: 18).

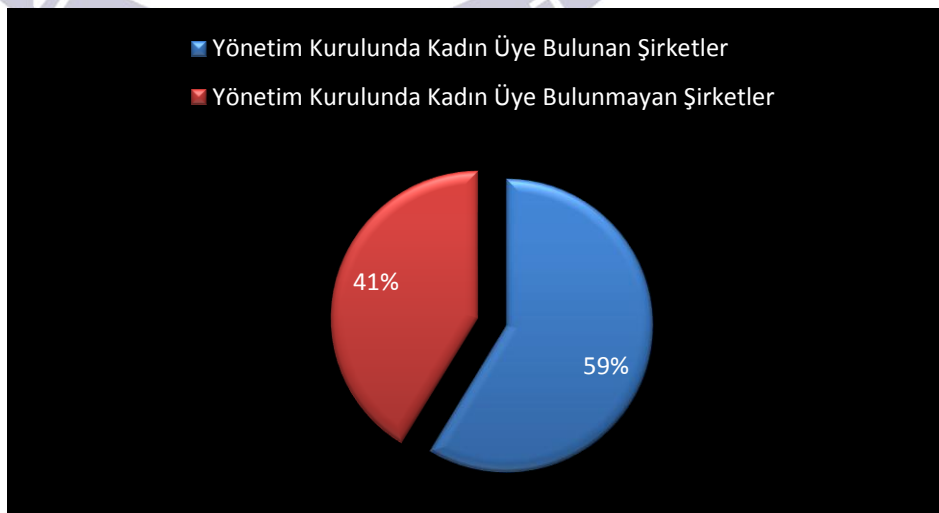
Türkiye’de kurumsal yönetim ilkelerinde 2012 yılına kadar yönetim kurulunda kadın üyelerin yer alması gerektiğine ilişkin bir hüküm yer almamıştır. 2012 yılında Seri: IV, No:57 sayılı Kurumsal Yönetim İlkelerinin Belirlenmesine ve Uygulanmasına İlişkin Tebliğ’de Değişiklik Yapılmasına Dair Tebliğ ile “Yönetim kurulunda en az bir kadın üye bulunur” şeklinde düzenleme gerçekleştirilmiştir (Ocak, 2013: 110). Ancak bu ilkeye rağmen, 2012 yılında yönetim kurullarında en az bir kadın üyesi olan şirketlerin oranı %52,9 olarak gerçekleşmiştir. 2016 yılında da bu oran sadece % 59’a yükselmiştir. Dolayısıyla Resmî Gazete’ de yayınlanan bu tebliğe rağmen yönetim kurullarında kadınların yer alma düzeylerinde beklenen artış gerçekleşmemiştir. Bunun nedeni de düzenlemenin bir müeyyidesinin bulunmaması olarak değerlendirilebilir (Bakanlığı, 2018: 104).

Yine 2014 yılında 28871 sayılı Resmi Gazete' de yayınlanan Kurumsal Yönetim Tebliği ile “şirket, yönetim kurulunda kadın üye oranı için %25'ten az olmamak kaydıyla bir hedef oran ve hedef zaman belirlenir ve bu hedeflere ulaşmak için politika oluşturur. Yönetim kurulu bu hedeflere ulaşma hususunda sağlanan ilerlemeyi yıllık olarak değerlendirir” şeklinde bir düzenleme getirilmiştir. Bu düzenlemenin de Türkiye'de yönetim kurullarında yer alan kadınların sayısında artış sağlanması beklenmektedir (Otluoğlu vd. 2016: 749).

Aile ve Sosyal Politikalar Bakanlığı Temmuz 2018'de yayınladığı “Kadının Güçlenmesi Strateji Belgesi ve Eylem Planı (2018-2023) ile eğitim, sağlık, ekonomi, medya ve karar alma mekanizmalarına katılım olmak üzere 5 eksenle kadının konumu ve güçlenmesi için belirlediği hedefleri açıklamıştır. Buna göre kadınların karar alma mekanizmalarında yer alma düzeyini arttırmak için 2021-2022 yılında, Sermaye Piyasası Kurulu'nca yayınlanan “Kurumsal Yönetim İlkelerinin Belirlenmesine ve Uygulanmasına İlişkin Tebliğ” de değişiklik yapılması ve kadın üye bulundurma ilkesinin zorunlu hale getirilmesi hedeflenmiştir. Yine aynı Eylem Planı'nda 2020-2021 yılında kamu kurum ve kuruluşlarında orta ve üst düzey yönetici pozisyonlarında kadın temsiline artırılmasına yönelik mevzuatta değişiklik yapılmasına dair kanun tasarısı taslaklarının hazırlanması planlanmıştır (Bakanlığı, 2018: 214).

Sabancı Üniversitesi Kurumsal Yönetim Forumu tarafından 15 Şubat 2018 tarihinde düzenlenen 5. Türkiye Kadın Direktörler Konferansı'nda, “Türkiye'de Yönetim Kurullarında Kadın 2017” Raporu sunulmuştur. Rapora göre 2017 yılında BİST'e kayıtlı 404 halka açık şirketin 168'inin yönetim kurullarında kadın üye bulunmamaktadır. Dolayısıyla Grafik 1'de de görüleceği üzere yönetim kurullarında kadın üye yer almayan şirketlerin oranı 2017 yılında %41,3 olarak gerçekleşmiştir. Yönetim kurulunda en az bir kadın üye bulunan halka açık şirketlerin oranı ise % 58,7'dir.

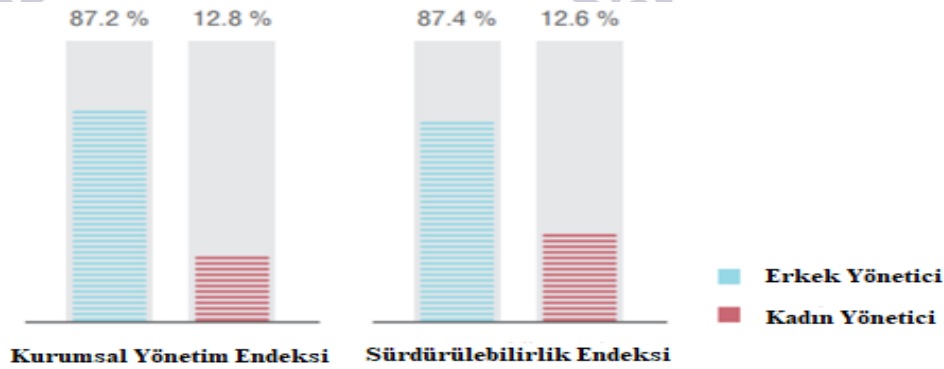
Grafik 1. 2017 Yılında Yönetim Kurulunda Kadın Üye Yer Alan ve Almayan BİST Şirketleri



Kaynak: Rapor:6

Raporda yer alan bilgilere göre 2017 yılında BIST' te yer alan şirketlerin yönetim kurullarına 386 kadın üye seçilmiştir. Bu rakam, 2017 yılında Türkiye'de halka açık şirketlerin yönetim kurullarında yer alan kadınların oranının % 13,9 olarak gerçekleştiğini göstermektedir. Aynı oran geçen yıl % 14,2 idi. Yönetim kurullarında yer alan 389 kadın üyenin 181'i, şirketi kontrol eden ailelerle ilişkili olan kadın üyelerdir. Dolayısıyla şirketi kontrol eden aileleri temsil eden kadın üyeler dışarıda bırakıldığında yani genel kabul gören deyimle 'cam tavanı kıran' kadın sayısı 201'dir. Bu rakamda şirketlerin yönetim kurullarında yer alan kadın üyelerin oranını (kontrol eden ailelerin kadın üyeleri hariç) % 7'ye düşürmektedir.

Grafik 2. Kurumsal Yönetim Endeksi ve Sürdürülebilirlik Endeksinde Yer Alan Şirketlerin Yönetim Kurulunda Yer Alan Kadın Üye Oranı



Kaynak: Rapor:18

Organizasyonlarda kadın çalışanların yönetim kademesinin üst düzeylerine yükselmesindeki görünmeyen engeller, cam tavan sendromu (Glass Ceiling Syndrome) olarak ifade edilmektedir (Yıldız, 2014: 73).

Son olarak raporda yer alan çarpıcı bir bilgede, hem Kurumsal Yönetim Endeksi hem de Sürdürülebilir Endeksinde yer alan şirketlerin yönetim kurullarında yer alan kadın üye oranı %12 olarak gerçekleşmesidir. Bu oran Türkiye'deki en kurumsal ve sürdürülebilirliği önemseyen şirketlerin bile cinsiyete dayalı önyargılarının bulunduğu göstermektedir.

3. LİTERATÜR

Yönetim kurulu cinsiyet çeşitliliğinin raporlama kalitesini etkileyebileceğine yönelik ampirik çalışmalar henüz çok yenidir. Şimdiye kadar yönetim kurulunda yer alan kadın üyelerin şirketlerin finansal performansına etkisi üzerine yapılmış çalışmalar yer almaktadır. Dolayısıyla Türkiye'de yönetim kurullarının cinsiyet çeşitliliği ile ilgili yapılmış olan çalışmalar incelendiğinde sürdürülebilirlik ya da kurumsal sosyal sorumluluk gibi finansal olmayan performans ile ilişkisi üzerine yapılmış bir çalışma bulunmamaktadır.

Bu bölümde Türkiye’de yönetim kurulunda yer alan kadın üyelerin şirketlerin finansal performansına etkisi üzerine yapılmış çalışmalar değerlendirilecektir. Ocak (2013) 2008-2012 yılları arası 101 şirketten elde ettiği 505 şirket/yıl verisi ile gerçekleştirdiği çalışmada, yönetim kurulunda yer alan kadın üyelerin oranı ve şirketlerin aktif kârlılık oranları arasında pozitif ilişkinin olduğunu ortaya koymuştur. Mentş (2011) yapmış olduğu çalışmada BİST Sanayi Endeksinde yer alan şirketlerin yönetim kurulunda yer alan kadın üyelerin oranı ile şirket performans göstergesi olarak belirlediği Tobin Q oranı arasında, negatif bir ilişki tespit etmiştir. Çalışmada bir diğer performans göstergesi olan aktif karlılık oranı ile yönetim kurulunda yer alan kadın üyelerin oranı arasında ise anlamsız bir ilişki olduğu tespit edilmiştir.

Otluoğlu vd., (2016) 2010-2015 yılları arasında BİST 100 endeksinde yer alan şirketlerin yönetim kurullarındaki kadın üye oranının aktif karlılığı ve nakit akışı üzerinde anlamlı ve pozitif yönlü bir etki yarattığını tespit etmiştir. BİST 100 Endeksi üzerine yapılan bir diğer çalışmada Karayel ve Doğan (2014) tarafından gerçekleştirilmiştir. Bu çalışmada da yönetim kurullarında kadın üye bulundurma ile şirketlerin aktif kârlılıkları arasında pozitif ilişki olduğu belirlenmiştir. BİST 100 Endeksi şirketleri ile ilgili yapılmış bir diğer çalışmada Ararat vd. (2010)’nin yapmış olduğu çalışmadır. Yönetim kurulunun çeşitliliği ile finansal performans arasındaki ilişkinin incelendiği çalışmada, kadın üyelerin şirket performansına pozitif yönde etki sağladığı bulunmuştur.

Eker ve Kurtaran (2017) çalışmalarında diğer çalışmalardan farklı olarak bankaların yönetim kurullarındaki kadın üyelerin finansal performansa etkisini incelemişlerdir. Çalışmanın sonucunda bankacılık sektörü açısından yönetim kurullarındaki kadın üye oranıyla finansal performans arasında herhangi bir ilişki bulunamamıştır

Uluslararası literatür incelendiğinde sayıları nispeten az olmasına rağmen bazı çalışmalarda, yönetim kurullarında yer alan kadın üye oranının, şirketin finansal olmayan performansı özellikle de kurumsal sosyal sorumluluğu üzerinde etkili olduğunu göstermektedir. Krüger (2009), Bear vd. (2010), Braun (2010) ve Galbreath (2011) tarafından yapılan çalışmalarda yönetim kurulunda yer alan kadın üye sayısı ile kurumsal sosyal sorumluluk arasında pozitif yönlü ilişki tespit edilmiştir. Ancak Eagly vd. (1995) tarafından yapılan bazı çalışmalarda da sınırlı bir etki veya erkek ve kadın yöneticilerin etkinliğinde genel bir farklılığın bulunmadığı belirlenmiştir. Bunun nedeni olarak ta üst düzey pozisyonlardaki kadınların, genellikle kurumsal stratejiye ve gözetime tam olarak katkıda bulunma becerilerini kısıtlayan ayrımcılık sorunuyla karşılaşmaları olarak değerlendirilmiştir (Rao ve Tilt, 2016: 334).

Son dönemde bu konuda yapılmış olan çalışmalardan biri olan İbrahim ve Hanefah (2018) tarafından yapılan çalışmada, şirketlerin yönetim kurulunda yer alan yöneticilerin cinsiyetleri, yaşları, bağımsızlığı ve milliyetleri ile sürdürülebilir raporlama kalitesi arasındaki ilişki incelenmiştir.

Sürdürülebilir raporlamayı ölçmek için daha önceki çalışmalarda da kullanılan ve 36 maddeden oluşan bir kontrol listesi kullanılmıştır. 2007-2011 yılları arasında Amman Borsası'nda işlem görmekte olan 117 şirkete ait 468 şirket/yıl verisi ile Panel Veri Analizi gerçekleştirilmiştir. Çalışmanın sonucunda bağımsız yönetim kurulu üyeleri, yabancı yönetim kurulu üyeleri ve kadın direktörler olmak üzere tüm yönetim kurulu çeşitlilik değişkenleri sürdürülebilir raporlama düzeyini olumlu ve anlamlı bir etki sağladığı belirlenmiştir.

Bir diğer çalışma ise Amar vd. (2017) tarafından yapılmıştır. Çalışmada 2008-2014 yılları arasında 541 şirket/yıl verisi ile Kanada'da halka açık şirketler örneklem olarak kullanılmıştır. Şirketlerden sürdürülebilir raporlama kapsamında; iklim değişikliği ile ilgili riskler ve fırsatlar, emisyon muhasebesi, karbon performansı ve yönetim konularında standart bir anketi gönüllü olarak tamamlamaları istenmiştir. Çalışmanın sonucunda Kadın üyelerin yer aldığı yönetim kurulları ve iklim değişikliği bilgilerinin gönüllü olarak açıklanması arasında olumlu bir ilişki olduğu tespit edilmiştir.

Al-Shaer ve Zaman (2016) İngiltere FTSE 350 Endeksinde yer alan 333 şirkete ait 2012 yılı verilerini kullanarak, yönetim kurulunda yer alan üyeler ile sürdürülebilir raporlama kalitesi arasındaki ilişkiyi analiz etmiştir. Çalışmada kadın üyelerin yer aldığı yönetim kurullarında daha yüksek kalitede sürdürülebilirlik raporlarının hazırlandığını tespit etmişlerdir.

Liao vd. (2015) yönetim kurulunda yer alan üyeler ile sürdürülebilir raporlama kalitesi arasındaki ilişkiyi analiz etmek için Birleşik Krallık' taki en büyük 329 şirkete ait verileri kullanmıştır. Sürdürülebilir raporlama göstergesi olarak şirketlerin sera gazı emisyonlarının açıklanmasının alındığı çalışmada yapılan Regresyon Analizi sonucunda cinsiyet çeşitliliği ile sera gazı emisyonlarının bilgisini açıklama eğilimi arasında anlamlı ve pozitif bir ilişki olduğu belirlenmiştir.

4. YÖNETİM KURULLARINDA CİNSİYET ÇEŞİTLİLİĞİNİN SÜRDÜRÜLEBİLİR RAPORLAMA KALİTESİ ÜZERİNDEKİ ETKİSİNİN ANALİZ EDİLMESİ

Yönetim kurullarında cinsiyet çeşitliliğinin sürdürülebilir raporlama kalitesi üzerindeki etkisini test edebilmek için Eşitlik 1'de yer alan Panel Veri Modeli kurulmuştur. Şirketlerin sürdürülebilir raporlama kalitesi, Küresel Raporlama Girişimi (Global Reporting Initiative-GRI) Standartlarına uygun olarak hazırladıkları sürdürülebilirlik raporları üzerinden ölçülmüştür. Dolayısıyla BİST' te işlem gören ve GRI raporlama standardına göre sürdürülebilir raporlama hazırlayan şirketler örneklem olarak alınmıştır. Örneklem olarak 2012-2015 yılları arasında düzenli olarak sürdürülebilirlik raporu hazırlayan 13 şirket kullanılmıştır. Böylelikle Eşitlik 1'de yer alan model, 52 şirket/yıl verisi kullanılarak Dengeli Panel Veri Analizi ile analiz edilecektir.

$$Sür_{it} = \beta_0 + \beta_1 Kad_{it} + \beta_2 Top_{it} + \beta_3 Bag_{it} + \beta_4 Roe_{p_{it}} + \beta_5 Buy_{it} + \beta_6 Kal + u_{it} \quad (1)$$

Eşitlik 1'de verilen modelde yer alan değişkenler şu şekilde açıklanmaktadır;

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Sür: i'nci şirketin, t zamanında sürdürülebilir raporlama skorunu göstermektedir. Bu değişken modelin bağımlı değişkenidir. Şirketlerin GRI metodolojisine göre hazırlanmış oldukları sürdürülebilirlik raporlarından elde ettikleri skora göre değerler almaktadır. Bu değer 100'e ne kadar yaklaşırsa, şirketin sürdürülebilir raporlama kalitesi o ölçüde yüksek olarak değerlendirilmektedir.

Kad: i'nci şirketin, t zamanında yönetim kurulunda yer alan kadın üye sayısının toplam üye sayısına oranını göstermektedir. Bu oran ne kadar yükselirse yönetim kurulunda o ölçüde kadın üyelerin yüksek olduğunu ifade etmektedir. Bu değişken şirketlerin kurumsal yönetim ilkeleri uyum raporlarında yer alan yönetim kurulu bilgilerinden yararlanılarak oluşturulmuştur.

Top: i'nci şirketin, t zamanında yıl içerisinde yapmış olduğu yönetim kurulu toplantı sayısını göstermektedir. Bu sayının artması ile şirketin diğer konularda olduğu gibi sürdürülebilirlik alanında da çalışmalarının artması beklenmektedir. Bu değişken şirketlerin kurumsal yönetim ilkeleri uyum raporlarında yer alan bilgilerden yararlanılarak oluşturulmuştur.

Bag: i'nci şirketin, t zamanında yönetim kurulundaki bağımsız üye sayısının toplam üye sayısına oranını göstermektedir. Bu sayının artması ile şirketlerin diğer finansal raporlarında olduğu gibi sürdürülebilir raporlama kalitesinin de artması beklenmektedir. Bu değişken şirketlerin kurumsal yönetim ilkeleri uyum raporlarında yer alan yönetim kurulu üyeleri ile ilgili bilgilerden yararlanılarak oluşturulmuştur.

Roe: i'nci şirketin, t zamanında öz sermaye karlılık oranını göstermektedir. Şirketin karlılığının artması ile sürdürülebilir raporlama kalitesinin artması beklenmektedir. Bu değişken net kar/ öz sermaye şeklinde hesaplanmaktadır. Şirketlerin faaliyet raporlarında yer alan bilanço ve gelir tablosu bilgilerinden yararlanılarak oluşturulmuştur.

Buy: i'nci şirketin, t zamanında büyüklüğünü temsil etmek üzere satışlarının doğal logaritmasını göstermektedir. İşletme büyüklüğünün artması ile sürdürülebilir raporlama kalitesinin artması beklenmektedir. Bu değişken şirketlerin faaliyet raporlarında yer alan gelir tablosu bilgilerinden yararlanılarak oluşturulmuştur. Bu değişken kontrol değişkeni olarak modele dahil edilmiştir.

Kal: i'nci şirketin, t zamanında kaldıraç oranını göstermektedir. Bu değişken Toplam Borçlar/Toplam Varlıklar şeklinde hesaplanmaktadır. Şirketlerin faaliyet raporlarında yer alan bilanço bilgilerinden yararlanılarak oluşturulmuştur. Değişken kontrol değişkeni olarak modele dahil edilmiştir.

Eşitlik 1'de yer alan modelin analizine geçilmeden önce Tablo 1'de tanımlayıcı istatistiklerine yer verilmektedir. Bu istatistiklere göre en yüksek sürdürülebilirlik raporlama skoru 94 olurken, en düşük sürdürülebilir raporlama skoru 38'dir. Örneklem olarak alınan şirketlerin sürdürülebilirlik skorları 68,53 gibi oldukça iyi bir değerdedir. Örneklemdeki şirketlerin bu alanda raporlama kalitesine özen gösterdikleri ifade edilebilir. Benzer şeyleri kadın üye sayısında söylemek pek mümkün

görünmemektedir. Kadın üyelerin yönetim kurulundaki ortalaması % 9,4'te kalmaktadır. Bu oran bazı şirketlerde sıfır olabilirken en yüksek olduğu şirkette sadece %27 olarak gerçekleşmiştir. Yönetim kurullarında yer alan bağımsız üye sayısı, kadın üye sayısına kıyasla daha yüksektir. Bağımsız üye sayısı ortalama %24'lere ulaşmaktadır. Bağımsız üye sayısı %36'lara kadar yükselmektedir. Karlılık oranları, şirket büyüklüğü ve kaldıraç oranına ilişkin değişkenlerin tanımlayıcı istatistikleri ayrıca Tablo 1'de incelenebilir.

Tablo 1. Tanımlayıcı İstatistikler

| Değişkenler | Ortalama | Standart Hata | En Büyük | En Küçük |
|-------------|----------|---------------|----------|-----------|
| <i>Sür</i> | 68.53107 | 15.86142 | 94.06780 | 38.00000 |
| <i>Kad</i> | 7.648324 | 6.435946 | 22.22222 | 0.000000 |
| <i>Top</i> | 9.403846 | 7.279462 | 27.00000 | 3.000000 |
| <i>Bag</i> | 24.65099 | 12.52025 | 36.36364 | 0.000000 |
| <i>Roe</i> | 0.952171 | 0.730302 | 4.406178 | -0.865105 |
| <i>Buy</i> | 22.51881 | 1.165963 | 24.95897 | 20.56913 |
| <i>Kal</i> | 0.530304 | 0.196896 | 0.896081 | 0.194746 |

Panel Veri Analizinde veri setinin bazı varsayımlara sahip olması gerekmektedir. Bu varsayımlar otokorelasyon probleminin, değişen varyans probleminin ve kesit bağımlılığının olmaması olarak sayılmaktadır. Eğer bu problemler söz konusu ise analiz sonucunda yanlış ve tutarsız tahminler üretilen olacaktır. Bu varsayımları sınamak için Wooldridge Otokorelasyon Testi, Greene Değişen Varyans Testi ve Pesaran Kesit Bağımlılık Testleri yapılmış ve sonuçları Tablo 2'de raporlanmıştır. Wooldridge Otokorelasyon Testi ve Pesaran Kesit Bağımlılık Testlerinin sonuçlarının istatistiki açıdan anlamlı çıkması, otokorelasyon ve kesit bağımlılık problemlerinin olduğunu, Greene Değişen Varyans Testinin istatistiki açıdan anlamsız çıkması ise değişen varyans probleminin olmadığını göstermektedir. Dolayısıyla Eşitlik 1'de yer alan Panel Veri Modelinin klasik tahminler kullanılarak analiz edilmesi, yanlış ve tutarsız tahminler üretecektir. Bu nedenle söz konusu problemlere dirençli tahminler üreten Driscoll-Kraay Yöntemi ile Eşitlik 1'deki model analiz edilecektir.

Tablo 2. Modelin İstikrar Koşulları

| Hipotez | Test Adı | Test İstatistiği | Olasılık Değeri |
|------------------------------|------------------|------------------|-----------------|
| H_0 : Otokorelasyon Yok | Wooldridge | 15.094 | 0,0022 |
| H_1 : Otokorelasyon Var | Otokor. Testi | | |
| H_0 : Sabit Varyans | Greene Değişen | 1,1718 | 0,2790 |
| H_1 : Değişen Varyans | Varyans Testi | | |
| H_0 : Kesit Bağımlılık Yok | Pesaran's Kesit | 6,661 | 0,0001 |
| H_1 : Kesit Bağımlılık Var | Bağımlılık Testi | | |

Panel Veri Analizinde analiz yöntemi olarak Havuzlanmış Veri Seti, Rassal Etkiler Ve Tesadüfi Etkiler olmak üzere 3 farklı yöntem kullanılmaktadır. Bu üç yöntemden hangisinin kullanılacağına karar vermek için ön testlerin yapılması gerekmektedir. Havuzlanmış Veri Seti Yaklaşımının Rassal Etkiler ve Tesadüfi Etkiler Yöntemi karşısında geçerliliğini test etmek için yapılan F testi ve Breusch-Pagan Düzeltilmiş Lagrange Çarpan Testi sonuçlarına göre Eşitlik 1'de yer alan modelin tahmininde, Havuzlanmış Veri Seti yaklaşımını kullanmak mümkün gözükmemektedir. Bu nedenle Hausman Testi ile Rassal Etkiler Ve Tesadüfi Etkiler Yönteminden hangisinin seçileceğine karar vermek gerekmektedir. Hausman Testi sonucunun istatistiki açıdan anlamlı çıkması, tesadüfi etkiler yönteminin seçilmesi gerektiğini göstermektedir.

Tablo 3. Uygun Analiz Yönteminin Belirlenmesi

| Hipotez | Test Adı | Test İstatistiği | Olasılık Değeri |
|---|------------------|------------------|-----------------|
| $H_0: \beta_i = \beta$ | F Testi | 3.746933 | 0.0013 |
| $H_1: \beta_i \neq \beta$ | | | |
| $H_0: \sigma_u^2 = 0$ | Breusch-Pagan | Kesit 0,50 | 0,4772 |
| $H_1: \sigma_u^2 \neq 0$ | Düz. Lagr. Zaman | 31,1 | 0.0001 |
| | Çarpan Testi | Kes.ve Zam 31,6 | 0,0001 |
| $H_0: E(\varepsilon_{i,t}/x_{it}) = 0$ | Hausman Tetsi | 34,7251 | 0,0001 |
| $H_0: E(\varepsilon_{i,t}/x_{it}) <> 0$ | | | |

Modelin uygun yönteminin ve istikrar koşullarının araştırılması sonucunda Driscoll-Kraay ve Tesadüfi Etkiler Yöntemi ile analiz edilmesi gerektiği ortaya konmuştur. Buna göre elde edilen sonuçlar Tablo 4'te raporlanmaktadır. Modelin genel olarak anlamlılığını gösteren F istatistiğinin olasılık değeri, modelin genel olarak % 1 istatistiki önem düzeyinde anlamlı olduğunu göstermektedir.

Tablo 4. Analiz Sonuçları

| Değişkenler | Katsayı | Standart Hata | Prob Değeri |
|--------------|----------------|---------------|------------------|
| <i>Kad</i> | 0,3891 | 0,1625 | 0,096*** |
| <i>Top</i> | 0,5274 | 1,0264 | 0.643 |
| <i>Bag</i> | -0,2640 | 0,1328 | 0.141 |
| <i>Roe</i> | -37,308 | 45,772 | 0.475 |
| <i>Buy</i> | -68,833 | 6,1153 | 0.002* |
| <i>Kal</i> | 90,702 | 25,854 | 0.039** |
| C | 1571,5 | 115,52 | 0.001* |
| Kesit G. 13 | R ² | | F-istati.2088,85 |
| Göz. Say. 52 | 0.5153 | | Prob 0.0001* |

*%1, **%5 ve ***%10 istatistiki önem düzeyinde anlamlı olduğunu göstermektedir.

Modelin R² değeri, modelin iyi derecede açıklama gücü olduğunu ifade etmektedir. Modelde yer alan değişkenlerden *Top* ve *Bag* değişkenleri istatistiki açıdan anlamlı çıkmamıştır. *Kad* değişkeni %10, *Buy* değişkeni %1 ve *Kal* değişkeni %5 istatistiki önem düzeyinde anlamlı çıkmıştır. İstatistiki açıdan anlamlı çıkan değişkenlerden *Kad* ve *Kal* değişkenleri sürdürülebilirlik raporlama kalitesini pozitif yönde etkilerken, *Buy* değişkeni sürdürülebilirlik raporlama kalitesini negatif yönde etkilemektedir. Sürdürülebilirlik raporlama kalitesini en fazla etkileyen değişken *Kal* değişkeni olurken en az etkileyen değişken *Kad* değişkenidir. Bu iki değişkenin katsayıları sırası ile 90,702 ve 0,389'dur.

5. SONUÇ VE DEĞERLENDİRME

Bu çalışmada şirketlerin yönetim kurullarındaki cinsiyet çeşitliliğiyle sürdürülebilir raporlama kalitesi arasında bir ilişkinin olup olmadığı incelenmiştir. Dengeli Panel Veri Analizi sonuçlarına göre, şirketlerin sürdürülebilir raporlama kalitesi üzerinde, yönetim kurulunda yer alan kadın üye oranının

anamlı ve pozitif yönde bir etkiye sahip olduğu görülmüştür. Dolayısı ile yönetim kurulunda kadın üye oranı arttıkça şirketin sürdürülebilir raporlama kalitesi de artmaktadır.

Literatür bölümünde de değinildiği üzere Türkiye’de yönetim kurulunda yer alan kadın üyelerin, şirketlerin finansal performansını olumlu yönde etkilediğine yönelik ampirik çalışmalar mevcuttur. Bu çalışma ile Türkiye’de de yönetim kurulunda yer alan kadın üyelerin şirketlerin finansal olmayan performansını olumlu yönde etkilediği tespit edilmiştir. Dolayısıyla şirketlerde yönetim kurullarının daha etkin bir şekilde işleyişini sağlamak ve hem finansal hem de finansal olmayan performansı arttırmak için kadın yönetim kurulu üyelerinin sayısının artırılması gerekmektedir. İster gönüllü isterse yasal düzenlemelerle olsun şirketler cinsiyet çeşitliliğini belli bir oranı tutturmak için değil, farklı görüş ve bakış açılarının temsil edildiği bir yönetim kurulu oluşturmak için sağlamalıdır.

Bu çalışmalar kadınların ekonomik karar alma merkezlerinde yer almasının şirket için önemini göstermektedir. Bu bağlamda şirket yönetimleri, menkul kıymet borsası ve sermaye piyasası kurulu gibi düzenleyici kuruluşların, kadınların ekonomik hayatta güçlenmesine yönelik kültürün oluşması adına etkili düzenlemeler gerçekleştirmeleri gerekmektedir.

Bundan sonra yapılacak çalışmalarda kadın yönetim kurulu başkanı, yönetim kurulundaki bağımsız üyelerin içindeki kadın üyelerin oranı ya da yönetim kuruluna bağlı komitelerdeki ve üst yönetimdeki kadın varlığı dikkate alınarak çalışma genişletilebilir.

KAYNAKÇA

- Aksoy, M. A. (2013). Türk Kurumsal Yönetim Düzenlemeleri Kapsamında Anonim Şirket Yönetim Kurulu. Gazi Üniversitesi Hukuk Fakültesi Dergisi, 17(1), 45-76.
- Al-Shaer, H., ve Zaman, M. (2016). Board Gender Diversity and Sustainability Reporting Quality. Journal of Contemporary Accounting & Economics, 12(3), 210-222.
- Ararat, M., Aksu, M. H., ve Tansel Cetin, A. (2010). The Impact of Board Diversity on Boards' Monitoring Intensity And Firm Performance: Evidence From The Istanbul Stock Exchange. <https://ssrn.com/abstract=1572283>
- Ararat, M., ve Yurtoğlu, B. B. (2012). Sermaye Piyasası Kurulu'nun Kurumsal Yönetim Konulu Tebliği ile İlgili Genel Değerlendirme Ve Yorum. <http://research.sabanciuniv.edu/18885/1/TebliğSon.pdf>
- Aile ve Sosyal Politikalar Bakanlığı (2018). “Kadının Güçlenmesi Strateji Belgesi ve Eylem Planı”. Ankara.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Ben-Amar, W., Chang, M., ve McIlkenny, P. (2017). "Board Gender Diversity and Corporate Response to Sustainability Initiatives: Evidence From The Carbon Disclosure Project". *Journal of Business Ethics*, 142(2), 369-383.
- Ibrahim, A. H., ve Hanefah, M. M. (2016). "Board Diversity and Corporate Social Responsibility in Jordan". *Journal of Financial Reporting and Accounting*, 14(2), 279-298.
- Karayel, M., ve Doğan, M. (2014). "Yönetim Kurulunda Cinsiyet Çeşitliliği ve Finansal Performans İlişkisi: BİST 100 Şirketlerinde Bir Araştırma". *Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 19(2), 75-88.
- Liao, L., Luo, L., ve Tang, Q. (2015). Gender Diversity, Board Independence, "Environmental Committee and Greenhouse Gas Disclosure". *The British Accounting Review*, 47(4), 409-424.
- Menteş, S. A. (2011). "Gender Diversity at the Board and Financial Performance: A Study on ISE (Istanbul Stock Exchange)". *Middle Eastern Finance and Economics*, 14, 6-15.
- O'connell, V., ve Cramer, N. (2010). "The Relationship Between Firm Performance and Board Characteristics in Ireland". *European Management Journal*, 28(5), 387-399.
- Ocak, M. (2013). "Yönetim Kurulu ve Üst Yönetimde Yer Alan Kadınların Finansal Performansa Etkisi: Türkiye'ye İlişkin Bulgular". *Muhasebe ve Finansman Dergisi*(60): 107-126.
- Otluoğlu, E., Sarı, E. S., ve Otluoğlu, K. Ö. (2016). "Yönetim Kurulu Çeşitliliğinin Finansal Performansa Etkisi: BİST 100 Üzerine Bir Araştırma". *Journal of International Social Research*, 9(46): 749-758.
- Önder, Ş. (2018). "Kurumsal Raporlamanın Yeni Trendi Entegre Raporlama". Bursa: Ekin Yayınevi.
- Rao, K., ve Tilt, C. (2016). "Board composition and corporate social responsibility: The role of diversity, gender, strategy and decision making". *Journal of Business Ethics*, 138(2): 327-347.
- IWD. (2018). "Sabancı University "2017 5th Annual Report Women On Board Turkey". https://iwdturkey.sabanciuniv.edu/sites/iwdturkey.sabanciuniv.edu/files/2018report_20180214_dijital.pdf
- Yıldız, S. (2014). "Türkiye'de Cam Tavan Sendromunun Varlığı Üzerine Bir Araştırma". *Organizasyon ve Yönetim Bilimleri Dergisi*, 6(1): 72-90.

**TURİZM GELİRLERİ VE EKONOMİK BÜYÜME ARASINDAKİ İLİŞKİ: GRANGER
NEDENSELLİK TESTİ İLE ARAŞTIRMA**

Dr. Öğr. Üyesi Savaş ERDOĞAN*

Şeyma TORBA**

ÖZET

Turizm, gelişmekte olan ülke ekonomileri için sosyal, kültürel ve ekonomik bağlamda önemli hizmet sektörlerinden birisi olarak karşımıza çıkmaktadır. Ayrıca turizm gelirleri ödemeler bilançosu açıklarını gidermekteki rolü açısından önemli bir gelir kalemidir. Bu bağlamda çalışmada, 2003/1-2017/4 dönemleri arası turizm gelirleri ve ekonomik büyüme arasındaki ilişki ADF Birim Kök Testi ve Granger Nedensellik Testi ile ortaya konulmaya çalışılmıştır. Uygulama sonuçlarına göre; %10 anlamlılık düzeyinde ekonomik büyümeden turizm gelirlerine doğru tek taraflı bir nedenselliğin olduğu söz konusu olmuştur.

Anahtar Kelimeler: *Turizm Gelirleri, Nedensellik, Ekonomik Büyüme, Birim Kök Testi.*

Jel Kodları: *L83, O40*

ABSTRACT

Tourism is one of the important service sectors in the social, cultural and economic context for developing countries. Moreover, tourism revenues are an important income item in terms of their role in eliminating the balance of payments deficits. In this context, the relationship between tourism revenues and economic growth between 2003/ 1- 2017/ 4 periods was tried to be demonstrated by ADF Unit Root Test and Granger Causality Test. According to results of the application; at the level of 10% significance, there is a one-way causality relation from economic growth to tourism revenues.

Keywords: *Tourism Revenues, Causality, Economic Growth, Unit Root Test.*

Jel Cods: *L83, O40*

1.GİRİŞ

Turizm, dünya gayrisafi hasılasının önemli bir bölümünü oluşturması nedeniyle dikkat çeken sektörlerden bir tanesidir. Harcanabilir gelirdeki turizme ayrılan payın artması, ulaşım ağlarının gelişmesi, bilgiye ulaşımın kolaylaşması ve sosyal medya sayesinde insanlar merak ettikleri ve şimdiye

* Selçuk Üniversitesi, Selçuk Üniversitesi İ.İ.B.F. İktisat Bölümü Kampüsü, Konya, Türkiye, serdogan@selcuk.edu.tr

** Selçuk Üniversitesi, Alavardı Mh. Güllü Sk. Defne Apt. 2/2, Konya, Türkiye, symtrb@gmail.com

dek görmedikleri yerleri görme isteklerinin artması turizmin gelişmesine katkı sağlamıştır (Dilber, 2007:205). Ödemeler bilançosunun cari işlemler hesabındaki uluslararası hizmetler kısmında yer alan turizm görünmeyen bir ihracat kalemidir. Bu nedenle ülkeye sağladığı döviz gelirleri ile dış açıklarının giderilmesine ve bütçe açıklarının finansmanına önemli katkılarda bulunmaktadır. Turizm sektörü emek yoğun bir sektördür buna bağlı olarak vasıfsız emeğe istihdam alanı yaratmaktadır. Turizm sektörü emek yoğun bir sektör olmasına rağmen sanayi sektörünün gelişmesine de katkı sağladığı bir gerçektir. Artan turist sayısı daha çok otel, ulaşım ve gayrimenkul kiralama gibi ihtiyaçları beraberinde getirecek ve bu yapılanmalar inşaat sektörünün de canlanmasına bu sektördeki istihdam artışını neden olacaktır (Yamak vd. 2012:206).

Turizm faaliyetlerini önemli kılan yemek ulaşım konaklama ve eğlence faaliyetlerine yönelik talep artışının yurt içi cari üretim düzeyini yükselterek gelir seviyesinin arttırması ve emek yoğun olan bu sektörün istihdamına olumlu katkı sağlamasıdır. Bir başka etmen ise ülkelerin ihtiyaç duyduğu döviz ihracatı arttırılmasına kıyasla daha kısa sürede daha az kaynak ile sağlamasıdır (Uysal vd, 2003; 164).

Türkiye’de turizm 24 Ocak 1980 kararlarından sonra ithal ikameciliğin terk edilip ihracata dayalı büyümenin benimsenmesiyle beraber önem kazanmıştır. İlk olarak 1982 yılında Turizm Teşvik Kanunu ile sektöre çok önemli yatırım ve mali destek sağlanmıştır (Yamak vd. 2012: 206). Günümüz de görünmeyen önemli bir kalem olarak karşımıza çıkmaktadır.

Bu çalışmada, ülkemiz açısından cari işlemler açığını azalıcı bir öneme sahip olan turizm gelirleri ile Güçlü Ekonomiye Geçiş Programı sonrasında (2003 sonrası) ekonomik büyüme arasındaki ilişki çeyrek dönemler itibari ile nedensellik testi yardımı ile analiz edilmiştir.

2. LİTERATÜR TARAMASI

Turizm gelirlerinin önemi 1980’li yıllarda gündeme gelmiş ve birçok ampirik çalışmaya konu olmuştur. Çetintaş vd. (2003), çalışmasında 1964- 2006 dönemi turizm gelirleri ve ekonomik büyüme arasındaki uzun ve kısa dönemli ilişki ARDL testi ve nedensellik yöntemi ile araştırılmıştır. Kısa dönemde iki değişken arasında bir ilişki bulunamazken, nedensellik testi sonuçlarına göre turizm gelirlerinden ekonomik büyümeye doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi olduğunu ifade etmiştir. Uysal vd. (2003), çalışmasında turizm gelirleri ve büyüme arasındaki ilişkiyi 1992-2003 verileri ile Granger nedensellik testi ile araştırmıştır. Çalışma sonucunda iki değişken arasında karşılıklı bir ilişkinin olduğunu ve turizm gelirlerinin ekonomik büyümeyi olumlu etkilediğini göstermiştir. Yavuz (2006), çalışmasında 1991/1- 2004/4 dönemleri verileri ile turizm gelirleri ve ekonomik büyüme arasındaki ilişki birim kök ve Granger nedensellik testi ile beraber Toda- Yamamoto yaklaşımına göre incelenmiştir. Bu yaklaşım sonuçlarına göre turizm gelirleri ile ekonomik büyüme arasında bir nedensellik ilişkisi olmadığı ifade etmiştir. Bahar (2006), çalışmasında 1963-2006 dönemine ait verileri ile turizm gelirleri ve büyüme arasındaki ilişki VAR modeli kurarak incelemiştir. Turizmin ekonomik

büyüme üzerinde olumlu bir etki yarattığı ve ikisi arasında uzun dönemli karşılıklı bir ilişki olduğu sonucuna varmıştır. Şahbaz (2007), çalışmasında turizm gelirleri ile büyüme arasındaki ilişkiyi nedensellik testi ile araştırmış bunun sonucunda turizm gelirlerinden büyüme doğru tek yönlü bir ilişkinin olduğu sonucuna varmıştır. Ayrıca tahmin sonuçlarını etki- tepki fonksiyonları ve varyans ayrıştırma grafikleriyle incelemiş ve büyümedeki pozitif bir şokun turizm gelirlerine aynı yönde etki ettiğini, ekonomik büyümedeki pozitif bir şokun ise turizm gelirlerini önce arttırma sonra ise azalma yönünde bir tepki verdiğini belirtmiştir. Kara vd. (2012), çalışmasında turizm gelirleri ile ekonomik büyüme, turizm gelirleri ile cari işlemler dengesi, reel döviz kuru ve turizm gelirleri arasındaki ilişkiyi ölçmek amacıyla ayrı ayrı üç model oluşturmuş ve 1991-2001 dönemi turizm gelirlerini veri olarak kullanmıştır. Her bir model için Engle-Granger, Var analizi ve Granger nedensellik analizlerini uygulamıştır. Uygulama sonuçlarına göre büyümeden turizm gelirlerine tek yönlü, turizm gelirlerinden cari işlemler dengesine doğru çift yönlü ve döviz kurundan turizm gelirlerine doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi olduğu sonucuna varmıştır. Yamak vd. (2012), çalışmasında turizm gelirlerinin ekonomik büyüme üzerindeki etkisi tarım, sanayi ve hizmet sektörleri bazında incelemiştir. Değişkenler arasında kısa dönem ilişkisi ortaya koymak amacıyla Granger nedensellik testi, uzun dönem ilişki ise Engle- Granger ve Johansen-Juselius koentegrasyon yöntemleri ile araştırmıştır. Elde edilen bulgulara göre değişkenler arasında herhangi bir uzun dönem ilişkisi tespit edememiştir. Turizm gelirleri ile sanayi ve hizmet sektörü arasında kısa dönemli anlamlı bir ilişki olmasına rağmen, söz konusu değişkenlerin reel GSMH ve tarım sektörü arasında herhangi bir kısa dönem ilişki bulunmamaktadır. Turist başına düşen reel GSMH tarım, sanayi ve hizmet sektörleri arasında herhangi bir nedensellik ilişkisi bulunamamıştır. Çoban vd. (2013), çalışmasında 1963-2010 dönemleri arası veriler ile turizm gelirleri ve büyüme arasındaki kısa ve uzun dönemli ilişkiyi eşbütünleşme analizi ve nedensellik yöntemi ile araştırmıştır. Uygulama sonuçlarına göre iki değişken arasında kısa dönem bir ilişki bulunamazken, turizm gelirlerinden ekonomik büyüme doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi olduğu sonucuna varılmıştır. Samırkaş vd. (2014), çalışmasında Türkiye’de 2003/1 çeyrek- 2013/3 çeyrek dönemlerini kapsayan reel turizm gelirleri ve reel gsyih verileri arasındaki ilişkiyi nedensellik testi ile sınımıştır. Test sonuçlarına göre hem turizm gelirlerinden ekonomik büyüme hem de ekonomik büyümeden turizm gelirlerine doğru çift yönlü bir ilişkinin olduğu sonucuna varmıştır. Kamacı vd. (2014) çalışmasında, turizm gelirleri ile büyüme arasındaki ilişkiyi 1995-20011 verileri ile Türkiye ile birlikte Azerbaycan, Kazakistan, Makedonya ve Özbekistan için nedensellik analizi ile incelemiştir. Bulunan sonuçlar neticesinde turizm gelirleri ve büyüme arasında çift yönlü nedensel bir ilişkinin olduğunu ortaya koymuştur. Kanca (2015), çalışmasında 1980-2013 verileriyle turizm gelirleri ve büyüme arasındaki ilişkinin olup olmadığını test etmek amacıyla birim kök testi ile durağanlığı ölmüş ardından nedensellik testi uygulayıp modeli En Küçük Kareler Yöntemi ile tahmin etmiştir. Bunu sonucunda turizm ve ekonomik büyüme arasında pozitif yönlü bir ilişki olduğu sonucuna varmıştır. Ülker (2016),

çalışmasında 1980 – 2014 dönemi verileri ile turizm gelirleri ve büyüme arasındaki nedensellik ilişkisini araştırmıştır. Çalışma sonucunda turizm gelirlerindeki artış hem kısa dönemde hem de uzun dönemde artırıcı bir etkiye sahip olduğunu ayrıca aralarındaki nedensellik ilişkisinin turizm gelirlerinden GSYİH doğru tek yönlü olduğu sonucuna varmıştır.

3. VERİ SETİ VE YÖNTEM

Turizm gelirleri ve ekonomik büyüme arasındaki ilişkiyi araştırmayı amaçlayan bu çalışmada 2003 - 2017 dönemleri üçer aylık GSYİH ve turizm geliri verileri kullanılmıştır. GSYİH ve turizm gelirlerine ait veriler Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası Elektronik Veri Dağıtım Sistemi (EVDS) 'nden elde edilmiştir.

TL cinsinden verilmiş olan GSYİH değerleri o döneme ait ortalama döviz kuru kullanılarak dolar cinsine çevrilmiştir. Değişkenler mevsimsellik etkisinden arındırılmış, aralarındaki ölçüm farkının en aza indirgenmesi amacıyla logaritmaları alınmıştır. Daha sonra serilerin durağan olup olmadığını ölçmek amacıyla ADF birim kök testi uygulanmış, serilerin durağanlık dereceleri belirlendikten sonra Granger nedensellik testiyle değişkenler arasındaki nedensellik ilişkisinin yönü tespit edilmeye çalışılmıştır.

4. BULGULAR

Bu çalışmada kullanılan turizm gelirleri ile ekonomik büyüme arasındaki ilişkiye ait zaman serileri analizinde ilk olarak, verilerin durağan olup olmadığı Genişletilmiş Dickey Fuller Birim Kök Testi yardımı ile analiz edilmiştir.

Tablo1, GSYİH ADF Birim Kök Testi Sonuçları

| Düzye | t-İstatistiği |
|--------------------------------|---------------|
| ADF Test İstatistiği | -3.825278 |
| Test Kritik Değeri (%5) | -2.911730 |

GSYİH değerlerinin durağanlığını ölçmek amacıyla uygulanan ADF birim kök testi sonuçları yukarıdaki tabloda gösterilmiştir. Yukarıdaki tablo sonuçlarına göre düzeyde GSYİH test istatistiği değeri, mutlak değerce %5 kritik değerden büyük olduğu için serinin düzeyde durağan olduğu anlaşılmıştır.

Tablo2. Turizm Gelirleri ADF Birim Kök Testi Sonuçları

| Düzye | t-İstatistiği | Düzye I | t-İstatistik |
|-------------------------|---------------|-------------------------|--------------|
| ADF Test İstatistiği | -2.114153 | ADF Test İstatistiği | -3,097494 |
| Test Kritik Değeri (%5) | -2.915522 | Test Kritik Değeri (%5) | -2.915522 |

Yukarıdaki tabloda verilen turizm gelirleri ADF Birim kök testi sonuçlarına göre seri düzeyde durağan değildir. Seriyi durağanlaştırmak amacıyla I. farkı alınmış ve bunun sonucunda test istatistik değerinin mutlak değerce %5 test kritik değerinden büyük olması ($3,097494 > 2,915522$) serinin durağan hale geldiğini göstermektedir.

Durağan hale getirilen verilerin arasındaki nedensellik ilişkisinin analiz edilebilmesi için VAR Analizi yardımı ile en uygun gecikme değeri elde edilmeye çalışılmıştır. Değişkenler arasında kısıtlamalı olarak kurulan analizde ilk beş gecikmede en uygun gecikme sayısı Akaike Bilgi Kriter değerinin en küçük olduğu dördüncü gecikme olarak belirlenmiştir.

Tablo3. Gecikme Uzunluklarının Belirlenmesi

| | AIC |
|---|------------|
| 1 | -3.688174 |
| 2 | -3.784222 |
| 3 | -4.002073 |
| 4 | -4.239626* |
| 5 | -4.193059 |

Gecikme uzunlukları belirlendikten sonra turizm gelirleri ve ekonomik büyüme arasındaki ilişkinin hangi yönde olduğunu başka bir ifadeyle iki değişken arasındaki ilişkilerin tek taraflı mı? Yoksa çift taraflı mı? olduğu Granger Nedensellik Testi yardımı ile test edilmiştir.

Tablo 4. Nedensellik Testi Sonuçları

| | | F-İstatistik | Olasılık Değeri | Sonuç |
|---------------------------|---|--------------|-----------------|--------------|
| Ho Hipotezi | Turizm gelirleri, ekonomik büyümenin nedeni değildir. | 0.55314 | 0.6977 | Kabul |
| Alternatif Hipotez | Turizm gelirleri, ekonomik büyümenin nedenidir. | | | Red |
| Ho Hipotezi | Ekonomik büyüme, turizm gelirlerinin nedeni değildir. | | | Red |
| Alternatif Hipotez | Ekonomik büyüme, turizm gelirlerinin nedenidir. | 2.27177 | 0.0759 | Kabul (% 10) |

Granger nedensellik sonuçlarına göre %10 anlamlılık düzeyinde ekonomik büyümeden turizm gelirlerine doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisinin olduğu sonucuna varılmıştır.

5.SONUÇ

Türkiye’de 24 Ocak 1980 kararları ile ithal ikameciliğin terk edilip ihracata dayalı büyüme modelinin benimsenmesi ile beraber turizm önemli bir sektör olarak karşımıza çıkmaya başlamıştır.

Bu çalışma turizm gelirleri ile ekonomik büyüme arasındaki ilişkinin yönünü tespit etmeyi amaçlamıştır. Analizde 2003/1-2017/4 dönemleri arası GSYİH ve turizm gelirleri verileri kullanılmıştır. TL cinsinden verilen GSYİH verileri o döneme ait ortalama döviz kuru kullanılarak dolar cinsine çevrilmiştir. Analizde kullanılacak olan veriler mevsimsel etkiden arındırılmış ölçüm farkının en aza indirilmesi amacı ile logaritmaları alınmıştır. Daha sonra serilerin durağanlık testleri yapılmış ve Granger nedensellik testi ile değişkenler arasındaki ilişkinin yönü belirlenmeye çalışılmıştır. Durağanlık testi sonucunda GSYİH verileri düzeyde, turizm gelirleri verileri ise birinci farklarında durağan olduğu ortaya çıkmıştır. Durağanlığı giderilen veriler için nedensellik testi öncesi en uygun gecikme sayısı VAR analizi yardımı ile tespit edilmeye çalışılmıştır. VAR analizi sonucunda dördüncü gecikmenin en uygun gecikme olduğu görülmüştür. Uygulanan nedensellik testi sonuçlarına göre ekonomik büyümeden turizm gelirlerine doğru tek yönlü bir ilişkinin olduğu %10 anlamlılık düzeyinde ortaya konmuştur. Sonuç olarak, Türkiye ekonomisi için ekonomik büyümenin sürekli ve istikrarlı biçimde devam etmesi turizm gelirleri açısından önemli bir etken olarak karşımıza çıkmaktadır.

KAYNAKÇA

Bahar, Ozan (2006). Turizm Sektörünün Türkiye’nin Ekonomik Büyümesi Üzerindeki Etkisi: VAR Analizi Yaklaşımı. Yönetim ve Ekonomi, 13(2): 137-150.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Çetintaş, Hakan, Bektaş, Çetin (2008) “Türkiye’de Turizm ve Ekonomik Büyüme Arasındaki Kısa ve Uzun Dönemli İlişkiler”, *Anatolia: Turizm Araştırmaları Dergisi*, 19(1): 37-44.
- Çil Yavuz, Nilgün (2006) “Türkiye’de Turizm Gelirlerinin Ekonomik Büyümeye Etkisinin Testi: Yapısal Kırılma ve Nedensellik Analizi”, *Doğuş Üniversitesi Dergisi*, 7(2): 162-171.
- Çoban, Orhan, Özcan C. Can (2013) “Türkiye’de Turizm Gelirleri- Ekonomik Büyüme İlişkisi: Nedensellik Analizi (1963-2010)”, *Eskişehir Osmangazi Üniversitesi İİBF Dergisi*, 8(1): 243-261.
- Dilber, İlkay (2007) “Turizm Sektörünün Türkiye Ekonomisi Üzerindeki Etkisinin Girdi- Çıktı Tablosu Yardımıyla Değerlendirilmesi”, *Yönetim ve Ekonomi*, 14(2): 205-220.
- Kamacı, Ahmet, Oğan, Yener (2014) “Turizm Gelirlerinin Ekonomik Büyüme Üzerine Etkileri: Panel Eşbütünlük ve Nedensellik Analizi”, *International Conference of Eurasian Economies 2014*.
- Kanca, O. Cenk (2015). “Turizm Gelirleri ve Ekonomik Büyüme: Türkiye Örneği (1980-2013)”, *Marmara Sosyal Araştırmalar Dergisi*, 8: 1-14.
- Kara, Oğuz, Çömlekçi, İstemi, Kaya, Vahdet (2012) “Turizm Gelirlerinin Çeşitli Makro Ekonomik Göstergeler ile İlişkisi: Türkiye Örneği (1992-2011)”, *Ekonomik ve Sosyal Araştırmalar Dergisi*, 8(1): 75-100.
- Samırkaş, Meryem, Samırkaş M. Can (2014) “Turizm Sektörünün Ekonomik Büyümeye Etkisi: Türkiye Örneği”, *İşletme Fakültesi Dergisi*, 15(1): 63-76.
- Şahbaz, Ümit (2007) “Zaman Serilerinde Nedensellik Analizi (Türkiye’de Büyüme ve Turizm Gelirleri Arasındaki İlişkinin Nedensellik Analizi)”, *Eskişehir: Anadolu Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Yüksek Lisans Tezi*.
- Türkiye Seyahat Acenteleri Birliği, http://www.tursab.org.tr/tr/turizm-verileri/istatistikler/turizmin-ekonomideki-yeri/gsmh-icindeki-payi-1963-_79.html. 29.06.2017.
- Uysal, Doğan, Erdoğan, Savaş, Mucuk, Mehmet (2003) “Türkiye’de Turizm Gelirleri ile Ekonomik Büyüme Arasındaki İlişki (1992-2003)”, *SÜ İİBF Sosyal ve Ekonomik Araştırmalar Dergisi*, 163-170.
- Ülker, Barış (2016). “1980- 2014 Dönemi Turizm Gelirleri ile Gayrisafi Yurtiçi Hâsıla Arasındaki Nedensellik İlişkisi: Türkiye Örneği”, *Diyarbakır: Dicle Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İktisat Anabilim Dalı, Yüksek Lisans Tezi*.
- Yamak, Nebiye, Tanrıöver Tuğçe, Güneysu, Filiz (2012). “Turizm- Ekonomik Büyüme İlişkisi: Sektör Bazında İnceleme”. *Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi*, 26(2): 205-220.

SANAT-MEKAN İLİŞKİSİ: MÜZELERİN SİNEMADA MARKA OLARAK KULLANIMI

Sinem TUNA*

ÖZET

“Marka” kavramı, günümüzün iletişim sistemleri içinde şüphesiz ki son derece belirleyici ve ayırt edici bir güce sahip. Reklamlardan sosyal medyaya, televizyondan sinemaya uzanan geniş mecrada, markaların ve marka algısının ulaşamadığı yığınlar neredeyse yok gibidir. Özellikle hizmet sunumu ve pazarlamasında markalaşmanın önemi ve gücü tekrar tekrar vurgulanmaktadır. Çalışmanın sınırları içerisinde, sanatın kamuoyuyla buluştuğu mekanlar olarak müzeler ele alınacaktır. İletişim teknolojilerindeki değişim ve yaygın kullanım, hem yerelde hem de küreselde müzelerin bilinirliğini arttırmakla kalmamış, marka değeri de yaratmıştır. Marka değeriyle birlikte bazı sanat eserlerinin bilinirliğinin, müzelerin önünde olması, mekanla eserlerin birlikte anılmasına neden olmuştur. Bir anlamda müzenin marka bilinirliği eser ya da eserlerle birlikte artmıştır. Müzelerin, markalaşma gereklilikleri ve süreçleri temelinden hareket edilerek, mekan ve sanat bağlamında bir değerlendirme yapılacaktır. İletişim boyutuyla birlikte sanatsal yapısı ağır basan sinema da, tıpkı diğer iletişim araçları gibi yığınlara ulaşmada önemli bir güce sahip. Diğer araçlardan farklı olarak sinemada sanat ve teknolojinin birleşmiş olması ilgiyi ve her dönemde popülerliği arttırmıştır. Sinemanın çok sesliliği ve kültürlerarası etkileşimi yansıtması, insan hikayeleriyle birlikte, her bir kültür ögesinin de sinemaya konu olmasını sağlar. Kültürel aktarımın aynı zamanda hafıza mekanları olan müzeler ve sergilenen eserler de sinemada boy gösterebilmektedir. Sinemada mekanın, hikayenin anlatımı açısından önemi düşünüldüğünde müzeler, bu katharsisi fazlasıyla sağlamaktadır. Çalışmanın ikinci aşaması, müze-marka ilişkisinin değerlendirilmesinden sonra müzelerin mekansal markalar olarak sinemayla ilişkisidir. Sinemaya konu olmuş müzelerin anlatımından yola çıkılarak, sanat-mekan-müze çerçevesinde seçilen filmler üzerinden bir inceleme yapılacaktır.

Anahtar Kelimeler: Marka, Müze, Sanat Eseri, Sinema

ART-SPACE RELATION: USE OF MUSEUMS AS A BRAND IN CINEMA

ABSTRACT

The concept of "brand" has undoubtedly a very decisive and distinctive power in today's communication systems. From the advertisements to the social media, from the television to the cinema,

* Dr.Öğr.Üyesi,Sinem Tuna, İstanbul Gelişim Üniversitesi, İktisadi İdari ve Sosyal Bilimler Fakültesi, Radyo Televizyon ve Sinema Bölümü, Cihangir Mahallesi Şehit Jandarma Komando Er Hakan Öner Sk. No:1 Avcılar, İstanbul, Türkiye, stuna@gelisim.edu.tr

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

the mass media, the masses and the brand sense can not reach the masses almost disappear. In particular, the importance and the importance of branding is emphasized repeatedly in service delivery and marketing. Within the borders of the research, the arts will be treated as places where the arts meet publicly. The change and widespread use of communication technologies has not only increased the awareness of the museum both locally and globally, but also created brand value. The recognition of some works of art along with the brand value, get ahead of museums, caused the place to be mentioned together with the works. In a sense, brand awareness of the museum has increased with works or works. An evaluation will be made in the context of space and art, based on the brands' requirements and processes of branding. The artistic structure of the cinema, with its communication dimension, is very important to reach the masses just like other means of communication. Unlike other mediums, the integration of art and technology in the cinema is interesting and has increased its popularity at all times. As cinema reflects the multitude of voices and intercultural interactions, it also allows each cultural subject to be subject to cinema, along with human narratives. At the same time as the cultural transfer, memories and exhibited works, which are memory spaces, can also appear in the cinema. When the scene in the cinema is thought to be important in terms of narration of the story the museums the provide this katharsis more than enough. The second stage of the research is the relationship of cinemas as spatial brands after the evaluation of the museum-brand relationship. The film will be reviewed through selected films in the frame of art-space-museum, starting from the narration of the museums subject to cinema.

Key Words: Brand, museum, artwork, cinema

1.GİRİŞ

“Çağdaş müzenin kökeni... giyotinin geliştirilmesine bağlıdır” der kültür eleştirmeni Georges Batille. Fransız ihtilali sürecinde, ihtilalcilerin giyotini kullanmaktan geri durmadıkları bilinir. Bu tarihi gerçeğin yanında, Batille’in vurguladığı mecazi anlam ise müzelerin, güç ve politikayla olan yakın ilişkisidir. Örneğin, 12. Yüzyılda kral Philippe Auguste için korunaklı bir kale olan “Louvre³⁰”, dünyanın en seçkin ve “marka” kabul edilen müzelerinden biridir artık.

“Güç” ve “sanat” ilişkisi içinde tarih boyunca, sanatın soyluların, zenginlerin ve siyasetçilerin güçlerini ispat etmede mükemmel bir araç olduğu görülmektedir. “Mesen”lik kavramına dayandırdığımız sanatın ve bilimin korunması ve geliştirilmesi Eski Mısır’a kadar uzanır (Rona, 1997:1205). Gerçek anlamına 17. yüzyılda kavuşmuş olmakla birlikte, sanat toplum içindeki prestiji

³⁰ Louvre, devrimi simgeleyen bir mekandır. 1792’de monarşiye son erildikten 9 gün sonra kraliyet sarayı ve hazineleri halkın mülkiyetine geçmiş ve saray müzeleştirilmiştir.

artıran bir olgu olmuştur. Sanat eserine sahip olmak aynı zamanda zenginlik göstergesidir. Kilise de gücünü pekiştirmek adına sanata ve sanatçıya yakınlaşmıştır.

Zaman zaman sanatçının sipariş üzerine de üretimler yaptığı meslek boyunca, eserle birlikte üreticisi de ünlenmeye başlamıştır (özellikle Rönesans ve sonrasında).

19.Yüzyılda “koleksiyoncuların” ortaya çıkması, sanat eserlerinin sistematik olarak sınırlandırılması ve gerçek anlamda müze mekanlarının tasarlanmasına, inşa edilmesine ya da dönüştürülmesine yol açmıştır.

Modern anlamda müzeler, sadece sahip oldukları koleksiyonlarla adlarını duyurmakla kalmazlar. Müzelerin adıyla neredeyse özdeşleşen eserlerle birlikte mimari varlıkları da son derece önemlidir. Geleneksel olarak sergileme tekniklerinin 21. yüzyılda yeterli olmadığı, daha geniş topluluklara seslenilmesi ve ulaşılması gerekliliği ortaya çıkmıştır. Bu anlayış hem postmodernizm hem de sürdürülebilirlik kavramlarıyla yakından ilişkilidir (Karadeniz, 407-408). İnsanların hem sergileri takip edebilecekleri, hem arkadaşlarıyla bir araya gelebilecekleri, hem alış-veriş yapabilecekleri, hem de yemek yiyebilecekleri mekanlardır artık. Mimarının dış görünümü de ilgi çekici olmalı, müzeyi benzerleri arasında farklılaştırabilmelidir.

İletişim sürecinin ve araçlarının çok yönlülüğü içine sanat eserleri ve sergi mekanları da dahil olmuştur. Her sunum ve gösterimin, sanatta bir ifade ve iletişim biçimi olmasından hareketle diğer iletişim kanalları da devreye girmektedir. Sanatın geniş kitlelere ulaşmasında, kabul görmesinde, devamlılığında ve teknolojiyle olan ilişkisinde, geçmişte ve günümüzde “sinema” son derece etkileyici bir iletişim aracıdır, bilinirlik ve markalaşma çerçevesinde güçlü imzadır. Gerçeği ve kurguyu kendi içinde harmanlayabilen sinema, izleyicinin önüne bir hikayeyi, bir nesneyi, bir mekanı şaşırtabilecek şekilde yeniden üretimle koyabilmektedir. Bazen klasiklerin izinden giderek bazen de klasik olanı modern ya da postmoderne dönüştürerek sinema bunu başarır. Sayısız anlatım ve aktarım yöntemi içinde, sinemanın en önemli öğelerinden biri “mekan” kullanımınıdır. Hikayenin içine daldığımız da kendimizi bulduğumuz alandır. Sinema, tasarlanmış ve yeniden yaratılmış mekanlara sahne olabildiği gibi gerçek ve gittiğimizde soluyabileceğimiz mekanlara da yansır.

Sanatın türleri içindeki iletişim bütünlüğü, sinema ile sanat eserlerinin sergilendiği müzeler arasında da güçlü bir bağ oluşturmuştur. Bakıldığında sinemaya tarihi boyunca, sanat eserlerinin ve müzelerin konu olduğu görülmektedir. Kurgusal müzeler ve eserler gibi gerçek eserler ve müzeler, beyaz perdeye aktarılmıştır.

Müzelerin, sinema aracılığıyla geniş kitlelerde “marka” ve bilinirlik algısı yaratması, başarılı işbirliğinin sonucudur. Sinemanın, görüntü teknolojisiyle sunduğu sınırsızlık, eserlerin ve mekanın birlikteliğiyle ortaya çıkan büyümlü atmosferi, hayranlıkla izlediğimiz bir dile dönüştürür. Gitmiş ve

görmüş olanlar için yeniden bir kurgu, meraklıları ve görmek isteyenler için ise mekan ve marka çekiciliğidir.

2. SANATIN MEKANLARI: MÜZELER

Uluslararası Müzeler Komitesi (ICOM), 2007 yılında müzeyi şöyle tanımlamıştır : “Toplumun ve gelişiminin hizmetinde olan, halka açık, insana ve yaşadığı çevreye dair tanıklık eden malzemelerin üzerinde araştırma yapan, bu malzemeleri toplayan, koruyan, bilgi paylaşan ve sonunda inceleme, eğitim ve zevk alma doğrultusunda sergileyen, kâr düşüncesinden bağımsız, sürekliliği olan” kurumdur (Erkan, 2014). Kavramsal olarak mitolojiyle ilişkilendirilir müze. Yunanca “mousa”, Latince “musa” olarak adlandırılan ilham perisidir (Erhat, 2011:208). Başka bir ifadeyle müzeler, müzelerin mekanlarıdır³¹.

Platon’un Akademisi’nde de, Aristoteles’in Lykeion’nda da mousa olduğu bilinmektedir. Müzenin mekânsal işlevlerinden biri de eğitimidir. İnsanlık tarihine damgasını vuran gerçek anlamdaki ilk müze mekanı ise İskenderiye Müzesi’dir. MÖ. 4. yüzyılda kurulan müze, yüzlerce yıl sanata ve bilime ev sahipliği yapmıştır. İçinde barındırdığı ve ihtişamla anılan İskenderiye Kütüphanesi Ön Asya’nın eğitim merkezi olmuştur. Yaklaşık 700 yıl boyunca kültür, sanat, bilim ve hafıza mekanıdır.

Eukleides, Arkhimedes, Batlamyus gibi bilginlere ev sahipliği yapan müze, festivallere, müsabakalara, konserlere ve tiyatrolara da yer vererek (Artun, 2006:13) müze imajının doğmasına ve müzelerin bilinirlik ve markalaşmasına öncülük etmiştir. Roy MacLeod İskenderiye Müzesi için şu ifadeyi kullanmaktadır: “Eğer Apollon’un mekanı Dephoi, Zeus’unki Olympos ise, o zaman müzelerin mekanı da kuşkusuz İskenderiye’dir” (MacLeod, 2004:13).

İskenderiye Müzesi’nden Pinakotek³²lere, gerçek anlamda sanatın müzelerle buluşması, müze mekânlarının bağımsız varlığı 18. yüzyılda hayat bulacaktır.

Müzeler, uzun zaman boyunca aristokratların tekelinde kalmıştır. Ziyaretçileri toplumun eğitimli ve asil sınıfıdır. British Museum, bu toplumsal ayrımın örneklerinden biridir. Müzeye giriş için üyelik ücreti ödenmektedir ve ziyaretler çeşitli koşullara bağlanmıştır (Schubert, 2000: 17). İngiltere’deki monarşi ve saray kuralları müzecilikte de belirleyici olmuştur. Katı kuralların hüküm sürdüğü, dek düze bakışın egemenliğindeki sanat ve sanat mekanları, çok geçmeden özgürlüklerine kavuşurlar.

Tarihin belirli bir döneminde, kimliği ve kültürü belirli bir toplumsal yapıda, topluluğu oluşturanların geçmişlerini görsel olarak okuyabilmeleri, algılayabilmeleri ve yorumlamaları gelecekte

³¹ “Dokuz müzden her biri ayrı bir yaratıcı uğraşı gözetir, ona esin kaynağı olur. Örneğin, Melpomene zaten müz sözcüğünden türeyen müziğin, Erato lirik şiirin, Kalliope epik şiirin, Kleio tarihin müzlerdir. Homeros destanlarına, Heredots tarihine müzleri anarak başlar. Müzlere Zeus ile hafıza tanrıçası Mnemosyne can verir. Ama Mnemosyne, müze âlemindeki asıl kudretini daha sonra, Rönesans başlarında belli edecektir.”

Artun, A. (2006), Sanat Müzeleri 1 Müze ve Modernlik, İstanbul: İletişim Yayınları, 11-12.

³² Antik Çağ’da resimlerin toplandığı mekanlar.

de varlık gösterebilme sürekliliğine bağlıdır. Sürekliliği sağlayan koşullardan biri ilkesel ve kuramsal temellere dayalı müzecilik anlayışıdır.

Toplumlar, geçmişlerine ilgi duyarlar ve bu ilginin temelinde yatan neden kimlik arayışıdır. “Toplumsal hafıza” olarak adlandırılan geçmiş, bir topluluğun tanımlı hâle gelmesi, kendisini diğerlerinden farklılaştırması için zorunlu bir ön koşuldur (Tuna, 2012: 35). Toplumsal hafızanın da belirleyicisi kültürdür. Bozkurt Güvenç’e göre, insan kültürüyle dünyaya egemen olmuş ve kültürüyle varlığını sürdürmüştür (Güvenç, 1997:10). Bu süreçte müzeler, kültürün devamlılığı ve gelecek kuşaklara aktarımında büyük önem taşımaktadır. Yaşadığımız dünyayı algılamamızda müzeler, adeta bir gösteri dünyasını temsil ederler. Bu temsiliyet beraberinde değişim ve dönüşümleri de getirir. Daha önce de değinildiği gibi güç ve siyasetle ilişkili mekanlar olan müzeler, Karsten Schubert’in ifadesiyle, politik ve sosyal değişimlere sismik bir zamanlamayla uyum sağlamıştır (İnel, 2001:21).

Günümüzün tapınak ve forumları olmanın çok ötesinde, mekanın çevrelediği eğlence ve haz diyarlarıdır. Sadece ‘mekan olma’, ‘toplama’, ‘yansıtma’ işlevinden çıkan müzeler, kamusal ilişkilerin ‘öznesi’ haline gelmiştir (İlıcak Aydınalp, 2010:21). Tarihsel süreçteki değişim nesne merkezli olmaktan insan merkezli olmaya doğrudur.

Tablo 1. Müze Tanımındaki Değişim

| | | |
|--------------------|---|-----------------------|
| Fonksiyonel | Müzeler toplar, korur, iletişim kurar, eğitim ve araştırma amacıyla sergiler | Nesne Merkezli |
| Amaçlı | Müzeler insanların zevk alması ve toplum yararına korunan koleksiyonlardan bilgi alması için vardır | İnsan Merkezli |

Kaynak: (Uralman, 2012: 247)

İlham perilerinin tapınaklarından, günümüzün dinamik ve yaşayan müzelerine kadar geçen sürede, müze mimarisinin değişiminde sergileme tekniklerinin değişimi, eğitim işlevinin hareketlenmesi ve iletişimin ön plana geçmesi temel belirleyicilerdir (Atagök, 2012: 277).

İlk müzelerin tapınak, kilise, saray ve villa mekanlarının kullanılmasından ibarettir. 20. yüzyıl müze mimarisinde değişim rüzgarları estirmiştir, “form işlevi izler” sloganından hareketle klasik üslup yerini nötr alanların oluşturduğu binalara bırakmıştır. Müzeler, sanatı ifade eden, sanattaki gelişmelere paralel, sanatla harmanlanan mekanlar olarak inşa edilmeye başlanmıştır. Eserler, mekanın önüne geçmiştir. Yanı sıra Solomon Guggenheim gibi mimarların, sanat eseri binaları, sanat-müze ilişkisine farklı bir yaklaşım getirmiştir. 1950’lerden itibaren eski fabrika binaları da müzelere dönüştürülmeye başlanmıştır.

Anıtsal yapılar, müzelerin inanılrlığını ve bilinirliğini önemli ölçüde etkilemektedir. Karamsar, kasvetli, ürkütücü iç mekanların yerini şeffaflık ve açıklık almıştır. Müze binalarının kutsallığı geride kalmış, insanların zaman geçirmekten keyif alacakları, aydınlık, hareket serbestliği sağlayan tasarımlar yapılmıştır (Atagök, 2012:278).

Bauman (2006), tüketim toplumunda bireylerin aktif olarak baştan çıkarılma peşinde olduğunu söyler. Eğlence ve haz arayışı içinde olan müze ziyaretçilerinin durumunu Bauman açıklıkla ifade etmiştir. Müzelerin, iletişim teknolojilerinden fazlasıyla yararlanabilmesi, insan-müze-teknoloji arasında şekillenen yeni bir iletişim biçimini sunmaktadır. En somut örneklerden biri, 1997 yılında Washington Üniversitesi tarafından müzelerde rehber olarak kullanılmak üzere geliştirilen Rhino ve Minerva iki robottur (Erbay, 2002:9). Başta çocuklar olmak üzere, ziyaretçilerin oldukça ilgisini çekmiştir.

Müzeler, tarihi ve kültürü barındıran hafıza mekanları olarak, gerçekten simülasyon gösterimlerine kadar işlevlerini günümüze uyarlamışlardır.

3. MÜZELERDE MARKALAŞMA

21. yüzyılın rekabet koşulları, hizmet sektöründe rakiplerden farklılaşmayı, çarpıcı olmanı sunmayı, denenmemiş olanı denemeyi ve en önemlisi ilklere imza atarak müşteriler tarafından takdirle kabul edilmeyi zorunlu kılmaktadır. Müzeciliğin hizmet sektörü içinde önemi bir yere sahip olması, ulusal ve uluslararası çapta hizmet sunmaları, tıpkı diğer hizmet sektörü üreticileri (yaratıcıları) gibi hatta onlardan birkaç adım önde olmayı gerektirecek şekilde marka üzerine yoğunlaşmalarını gerektirmektedir. Müzelerin, evrensel kültürel değerleri barındırdığı düşünüldüğünde dil, din, ırk ayrımı olmaksızın insanlığının tümüne hizmet sunan mekanlar olduğu ve herkesi sarıp sarmalayacak marka tanımlarına ve kodlarına gereksinim duydukları açıktır.

Işıl Karpaz Aktuğlu (2008) marka kavramını şöyle açıklar: “Marka; mal ve hizmetlerin kimliğini belirleyen, ürünün rakiplerinden ayırt edilmesini sağlayan, pazarlama yönetimi ve reklam yönetimi uygulamalarının odak noktası olarak tüketicilerle iletişim kurulmasını kolaylaştıran, üreticilere ve tüketicilere yasal birtakım avantajlar sağlayan, kısaca ürünü farklılaştıran isim, sembol, simge veya bunların birleşimidir”.

Müge Elden'e (2009) göre ise marka; “Sadece bir isim ya da logo gibi sembolik niteliklerle sınırlı olmayan, markaya yönelik somut ve soyut değerler toplamının yorumlanmasını içeren çok geniş bir perspektifi içermektedir”.

Tanımlardan da anlaşılacağı üzere marka, bir simge olmanın ötesinde bir ruha sahip olmalıdır, çünkü dinamik bir yapıdır. İnsanların tanıdığı, istediği, peşine düştüğü markanın ruhudur. İnsana dokunabilen marka, kendi liginde (pazarda) konumlandırılmayı doğru yapabilir.

Türkiye’de 29 Aralık 2017’de Muhteşem Showman (The Greatest Showman) adıyla gösterime giren ve Amerika’da sirkin ve eğlence endüstrisinin kurucularından olan Phineas Taylor Barnum’un hayat hikayesinin anlatıldığı film, başarılı bir müzikal olmanın ötesinde Barnum’un müze markası yaratmadaki başarısını da gözler önüne sermiştir. 1842’de Amerikan Müzesi’ni satın almış ve burayı bir gösteri merkezine dönüştürerek bir ilke imza atmıştır. New York müzesiyle ününü sağladıktan sonra ortaklarıyla birlikte P.T. Barnum’un Gezici Müzesi, Hayvanat Bahçesi, Karavan ve Hipodromu adlı bir gösteri merkezi kurmuş, öte yandan Bailey’le kurdukları Barnum ve Bailey Sirki ile Amerika’daki ününe ün katmıştır.

Şekil 1. Muhteşem Showman (The Greatest Showman)



Barnum’u uluslararası üne kavuşturan, denenmemiş olanı ilk kez denemeye cesaret etmesi, reklam ve pazarlama tekniklerini buna göre kurgulamasıydı. Amerikan toplumu içinde farklılıklarıyla dışlanan ya da yok sayılmaya çalışılan insanları bir araya getirerek yarattı markasını. Markasına bir ruh kondurmuştur adeta.

Birleşik Krallıkta kayıtlı olan yaklaşık 1800 müze ve galeri bulunmaktadır. Birbirinden farklı içeriklere sahiptirler. Eşsiz koleksiyonlar ve sergiler yer almaktadır her birinde. Ancak ziyaretçiler için tüm müze ve galeriler birbirine benzerdir. Bu nedenler müzeler farkındalık yaratma gereğini görmüşlerdir (Runyard, 1999:159).

2016 yılı verilerine göre dünya genelinde en çok ziyaret edilen müzelerin sıralaması şöyledir (www.sozcu.com.tr/6 Kasım 2017, 18.11.2018):

- 1.Çin Ulusal Müzesi, Pekin, Çin (7 milyon 550 bin)
- 2.Ulusal Hava ve Uzay Müzesi, Washington, ABD (7 milyon 500 bin)
- 3.Louvre Müzesi, Paris, Fransa (7 milyon 400 bin)
- 4.The National Museum of Natural History, Washington, ABD (7 milyon 100 bin)

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

5. Metropolitan Sanat Müzesi, New York, ABD (6 milyon 700 bin)

6. British Museum, Londra, İngiltere (6 milyon 420 bin)

7. Şangay Bilim ve Teknoloji Müzesi, Şangay, Çin (6 milyon 316 bin)

8. Ulusal Galeri, Londra, İngiltere (6 milyon 263 bin)

9. Vatikan Müzeleri, Vatikan (6 milyon 67 bin)

10. Tate Modern, Londra, İngiltere (5 milyon 839 bin)

Adı geçen müzelerin evrensel pazarda marka olmalarının ve milyonlarca ziyaretçiye ulaşmalarının nedeni marka özünde yatan farklılıktır. Bir markayı diğerlerinden ayıran markanın konumlandırılışdır (Ilıcak, Aydınalp, 2010:88). Markalaşma sürecinde başarıya ulaşmada planlama, koordinasyon ve denetim mekanizmalarının birlikte hareketi son derece önemlidir.

Müzelerin sahip oldukları koleksiyonlar, kurum kimliklerini yansıtmaktadır. Bu nedenle müze markasında sahip olunan koleksiyon yani kimlik belirleyici ve ayırt edicidir. Bir müzenin kimliğine duyduğu güven ziyaretçi sadakatinin de nedenidir. Marka bilinirliğin ötesinde kurum için artı değerdir.

Müzeler markalaşırken şu araçlara ihtiyaçları vardır (Rentschler&Hede, 2007: 157):

- ✓ Logolar, fontlar
- ✓ Pazarlama yardımı, web sitesi dizaynı
- ✓ Dekor, mimarlık, inşaat
- ✓ Dükkanlar, kafeler
- ✓ Hayırseverler
- ✓ Finans desteği
- ✓ Yöneticiler, küratörler, çalışanlar
- ✓ Biletler

Sayılanlara ek olarak daimi sergiler yanında değişen güncel sergiler ve müze mekanlarının sosyal organizasyonlara ev sahipliği yapmaları, markayı tanıtmak ve pekiştirmek adına sıklıkla kullanılan yöntemlerdir. Ziyaretçiler tekrar tekrar aynı mekana ve markaya çekilirler.

Küresel üne kavuşmuş müzelerin marka değerlerinin artmasında eğitimin de çok önemli bir payı vardır. Özellikle çocuklara ve gençlere yönelik düzenlenen gezi programları, eğitim grupları, yaş gruplarına göre hazırlanmış broşürler ve kataloglar yeni nesli interaktif olarak müzenin ve markanın içine dahil etmenin güncel yöntemleridir. Çocuklar ve gençler yeteneklerini ortaya koyarak sanata ilişkin üretimler yapabilmekte ve belki de farkında olmadıkları yaratıcı potansiyellerini fark edebilmektedirler. Müzelerin ve markalarının devamlılığı sadece kurumsal çalışmalara ağırlık verilmesiyle sınırlı olamaz. Genç kuşakların marka sadakatini devam ettirecekleri profesyoneller tarafından son derece iyi bilinmektedir.

Yukarıda belirtilen araçlar dışında, hareketli görüntülerin hafızada kalma ve yer etme gücü göz önünde bulundurulduğunda reklam filmlerinden tanıtım filmlerine kadar tüm iletişim teknolojileri sanatla örtüştürülerek kullanılmaktadır. Müzelerin hem mekânsal güzelliği hem de sahip oldukları koleksiyonların ihtişamı sinemada yapımcı ve yönetmenlerin de fazlasıyla ilgisini çekmektedir. Sadece müze mekanlarının filme sahne olduğu anlatımların yanında, müzelerin tarihi hikayelerini ve koleksiyonlarını konu edinen imgesel ve belgesel filmler mevcuttur. Sinema sektörü müzelerin kültürel büyüğünden yararlanırken, müzeler de yarattıkları marka ve imajlarını güçlendirmek adına sinemayla işbirliği yaparak istedikleri geniş hedef kitleye ulaşmakta, estetik bir anlatımla harmanlanmış filmlerle tanıtımlarını yapabilmektedirler.

4. GÖRÜNTÜNÜN SANATSAL HİKÂYESİ: SİNEMA

Sanat tarihçisi Heinrich Wölffin “Her zaman her şey mümkün değildir” (Bordwell, Thompson, 2008:440) diyerek aslında sanatın tüm alanlarında gelişim çizgisinin dönemsel koşullara bağlı olduğunu ifade eder. Görüntüyü kazıyarak var ettiğimiz zamanlardan görüntüyü hareketlendirdiğimiz zamanlara dek, herhangi bir zaman diliminin olanakları, sanatta üretim sınırlarımızı çizmiştir.

Sinema sanatı, hayatımıza 19. yüzyılda girmiş olmakla birlikte, insanoğlu gördüğü ve algıladığı dünyayı hafızaya kazımanın ötesinde somutlaştırma, nesneleştirme derdinde oldu. Kendi hafızamız dışında diğer insanlarınkine de ulaşmaya çalıştık, daha fazla görünür, bilinir kılmak istedik. Varlığımızı ispat etmenin yanında geleceğe iz bırakmak için çabaladık. İşte bu noktada sanat en önemli aracımız, ifade biçimimiz oldu.

Görüntüyü somutlaştırma çabamız ilk figüratif çizimlerle Paleolitik Dönem’de başladı. Günümüzden geriye doğru baktığımızda MÖ.17.000’ler hayal edilemez uzaklıkta gibi düşünülse de görüntüler arka arkaya bir zincir oluşturarak şimdiye dek uzandı. Fransa’daki Lascaux, İspanya’daki Altamira ya da Türkiye’deki Beldibi mağarası hiç fark etmez, görüntü dünyası insanın yaşadığı her yerdeydi.

İsveç’te Tunç Çağı’ndan kalma Kivik anıtı resimleri, MÖ. 5000’lere kadar dayandırılan Karagöz’ün de atası kabul edilen ‘gölge oyunları’, Mezopotamya’daki steller, Firavunlar dönemi Mısır’ında hikayelerin anlatıldığı duvar resimleri ya da papirüsler, Hitit İmparatorluğu’ndaki kabartmalar, Antik Yunan’da çanak çömleklere resmetmeler (Özön, 2008:4), Roma’daki eşsiz mozaikler görüntünün kaydedilmesine sadece birkaç örnektir.

Görüntüyü kaydetme biçim ve araçlarının sayısı hızla çoğaldı, yeni teknikler geliştirildi. Öte yandan insan kendi bedenini de bir araç olarak kullandı. Neolitik Dönem’e kadar tarihlendirilen dövme yöntemleri geliştirildi. Beden de artık görüntünün aracıydı. Bedenin görsel işlevine devinim de eklendi, oyun ve tiyatro. Oyun ve tiyatro, ister ritüel amaçlı olsun, ister tanrıları ve tanrıçaları eğlensin ya da bol bol düşündürüp öte yandan güldürsün görüntüye hareket kazandırdı.

Rönesans, görüntüye çığır açtı. Adeta hareket eden tuvaler çıktı karşımıza. Görüntü ve hareketin bütünlüğü resimden heykele ve de mimariye kadar uzandı. Sanatsal görüntü hiç olmadığı kadar önem kazandı, övgü aldı, prestij sağladı.

Sinemanın teknik ve estetik yaratımına katkı sağlayan en önemli isimlerden biri şüphesiz Hollandalı ressam Rembrandt van Rijn (1606-1669)'dir. Rembrandt'ın resimlerinde tek ışık kaynağı kullanarak, gölge-ışık oyunları yaratması ve tablolarına üç boyut kazandırması, fotoğraf ve sinemanın anlatım yöntemlerine temel oluşturdu ve bu yöntem günümüzde de ustanın adıyla bilinmektedir. Ünlü ressam sinemayı aydınlatmakla kalmamış, hayatı ve eserleri de sinemanın konusu olmuştur (Rembrandt, Alexander Korda, 1933. Rembrandt: İtham Ediyorum, Peter Greenaway, 2008).

Sanatın binlerce yıllık yolculuğuna 19. yüzyılda sinema da eklenmiş, yeni ifade biçimleri ve anlatım yöntemleri kitleleri kendine çekmiştir. Sinema kısa sürede sanat dünyası içinde kendi tarihi oluşturmuş, sanatla teknolojinin ortaklığı haline gelmiştir. En ilkel çizimlerden resme, heykelden video art'a, dansa, oyuna, tiyatroya, sahneye ve mimariye uzanan tüm eski ve geleneksel sanatları, kendi yarattığı görüntü dünyasında harmanlayabilmiştir.

Sinema en genç sanat dallarından biri olarak kalmamış, sanatın vücut bulduğu, konu edildiği, sunulduğu dünyadır aynı zamanda. Sanat dünyasını uluslararası boyuta taşımış, merak uyandırmış, takipçi kitleleri yaratmıştır. Sinemanın diğer sanat dallarıyla ilişkisi onlarca yıl içinde daha da zenginleşmiştir.

Sanatın her dalı gibi sinema da görsel hafızayı oluşturur, devamlılığını sağlar, gelecek nesillere taşır, kültürel bütünlüğü ifade eder ve somutlaştırır. Tıpkı hafızayı oluşturan ve sergileyen müzeler gibi. Sanat eserinin varlığı, görselleştirme çabası kadar koruma ve saklama çabasını da beraberinde getirir, esere verilen değer ile doğru orantılıdır.

Sinema, sanat eserlerini ve müzeleri, kendi doğal sunumlarını bozmadan kitlelere keyifle sunan bir araçtır. Zaman zaman belgesel, zaman zaman da gerçek mekanı değiştirmeden hikayeyi kurgulayıp görselleştirmiştir müzeleri ve eserleri. Daha önce değinildiği gibi müzeler, dönemlerinin güç ve politik merkezleri olarak günümü kadar uzanmışlar, markalaşma sürecine girerek önemlerini daha da arttırmışlardır. Bu süreçte, sinemayı bir iletişim aracı ve yöntemi olarak değerlendirmişlerdir.

5. BEYAZ PERDEDE SANAT-MEKAN-MÜZE

Çalışmanın sınırları çerçevesinde, müzelerin markalaşma sürecinde bilinirliklerini arttırmak ve pekiştirmek için sinema sanatıyla olan ilişkisi, yapımcı ve yönetmenlerin de müzelerin görsel dünyasını hikaye ve mekan olarak kullanmak istemeleri nedeniyle sanat-mekan-müze üçgeninde üretilmiş 8 filmi ele aldık. İmgesel ve belgesel olarak üretilmiş bu filmlerde, müzenin doğrudan senaryonun konusu olması yanında, sadece mekan olarak kullanılan müzeler, eserlerle birlikte ele alınanlar ve müze-sanatçı

ilişkinini ortaya koyan içerikler karşımıza çıkmaktadır. Konumuzun sınırları içinde filmlere bakacak olursak:

5.1. Topkapı (1964)

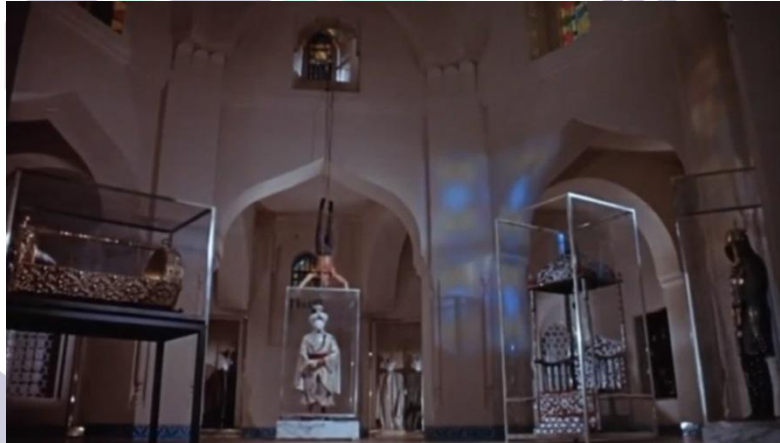
Yönetmen: Jules Dassin

Oyuncular: Peter Ustinov, Maximilian Schell, Robert Morley

Süre: 120 dk.

Yapım: ABD

Peter Ustinov'a "en iyi yardımcı erkek oyuncu" Oscar'ını kazandıran film, sinema tarihinin en iyi polisiyelerinden biri olarak kabul edilmektedir. Topkapı Sarayı Müzesi'nden II. Mehmet'in zümrütlü hançerini çalmaya çalışan beş hırsızın hikayesi üzerine kurulmuştur film. Soygun sahneleri uzun süre konuşulmuştur. Uluslararası bir hırsızlık çetesiyle Türk polisi arasındaki köşe kapmaca anlatılmaktadır. Dış mekan çekimlerinin tamamı İstanbul'da gerçekleştirilmiştir. Topkapı Sarayı Müzesi ve sahip olduğu eserlerin yer aldığı yapılardan biridir.



5.2. Müzedeki Hayalet (Belphégor-Le fantôme du Louvre, 2001)

Yönetmen: Jean-Paul Salomé

Oyuncular: Laurent Bateau, Sophie Marceau, Frédéric Diefenthal

Süre: 97 dk.

Yapım: Güney Kore

Mısır'da yapılan kazı çalışmaları sırasında bulunan tabuttaki bir mumya Paris'e Louvre Müzesine götürülür. Mumyanın yaşını belirlemek için yapılan çalışmalarda, bu bedene gizlenmiş ruh mummyadan ayrılır. Sonradan anlaşılır ki bu ruh, eski bir kahin olan Belphegor'a aittir ve şeytan diye de bilinir. Müzenin yakınında oturan Lisa adlı bir kız ise eden kaçan kedisinin peşinden müzeye gelir ve asıl

gerilim bundan sonra başlar. Belphegor, Lisa'nın bedenine girerek müzenin güvenliklerini öldürür ve kendisine ait olduğuna inandığı tarihi eserleri müzeden kaçırmaya başlar. Eserlerin ortadan kaybolmasından şüphelenen müze yetkilileri, dedektif Verlac ile çalışmaya başlar.

Çalışmada daha önce belirttiğimiz gibi güç ve politikayla ilişkili bir mekan olan Louvre Müzesi, pek çok defa sinemaya ev sahipliği yapmıştır ve gelecekte de hiç şüphesiz ki yapacaktır. 73 bin metrekarelik bir alana sahip müze, 350 binden fazla esere ev sahipliği yapmaktadır. Bu verilere göre dünyanın en büyük müzesidir ve bu özellikleriyle marka değeri ve bilinirliği de paralellik göstermektedir.



5.3. Rus Hazine Sandığı (Russky Kovcheg, 2002)

Yönetmen: Aleksandr Sokurov

Oyuncular: Sergey Dreyden, Aleksandra Kulikova, Leonid Mozgovoy, Mariya Kuznetsova

Süre: 99 dk.

Yapım: Rusya, Almanya, Japonya, Kanada, Finlandiya, Danimarka

Görünmeyen bir karakterin, St.Petersburg'taki Hermitage Müzesi'nde yaptığı geziyi anlatmaktadır. Görsel çekiciliği kadar, film teknik yönüyle de dikkat çekmiştir. Tek çekim tekniğiyle anlatım gerçekleşmiştir. Film, müzenin 33 ayrı salonunda, 3 canlı orkestrayla tek bir günde çekilmiştir. Yarı-belgesel olarak kabul edilen film, Rusya'nın son 300 yıllık tarihine de ışık tutmaktadır.

Tıpkı Louvre Müzesi gibi Hermitage Müzesi’de beyaz perdeyi renklendiren bir mekandır. Bunda müzenin, dünyanın en büyük resim koleksiyonuna sahip olmasının da etkisi vardır.



5.4. Da Vinci Şifresi (The Da Vinci Code, 2006)

Yönetmen: Ron Howard

Oyuncular: Tom Hanks, Audrey Tautou, Jean Reno

Süre: 174 dk.

Yapım: ABD

Dan Brown’nun aynı adlı romanından uyarlanan filmde, sembol uzmanı Prof. Robert Langdon, kendini bir anda gizemli olayların ve bir cinayetin içinde bulur. Bu macerada yol arkadaşı Sophie Neveu’dur. Robert ve Sophie’ye Louvre Müzesi’nde bırakılan bir ipucuyla başlayan macera Paris’ten Londra’ya, Roma’ya ve Vatikan’a kadar uzanır.

Louvre Müzesi’nin sahne olarak kullanıldığı film, gişede büyük başarıya ulaşarak, 678 milyon dolarlık hasılat elde etmiştir. Hem film hem müze istedikleri başarıya ulaşmıştır.



ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

5.5. Marina Abromovic: Sanatçı Aramızda (Marina Abromovic: The Artist is Present, 2012)

Yönetmen: Matthew Akers, Jeff Dupre

Süre: 106 dk.

Yapım: ABD

Yaklaşık 40 yıldır bedenini bir araç olarak kullanan ve düşündürten performanslar sergileyen Marina Abromovic'in yeni performansına hazırlanışını anlatan filmde, sanatçının eski performanslarından da kesitler yer almaktadır. Abromovic'in New York Moma'da 736 boyunca oturduğu performansı da içermektedir.

Dünyanın en çok ziyaret edilen modern sanatlar müzelerinden biri olan Moma (The Museum of Modern Art) bugün 200 bin kadar sanat eserini barındırmaktadır. Üç kadın girişimci (Abby Aldrich Rockefeller, Lillie Bliss ve Mary Quinn Sullivan) tarafından 1929 yılında kurulan müze, geçmişten bugüne sanat tutkunlarının ilgisini çekerek, sinema ile de dostluk kurmuştur.



5.6. Ziyaret Saatleri (Museum Hours, 2012)

Yönetmen: Jem Kohen

Oyuncular: Mary Margaret O'Hara, Bobby Sommer, Ela Piplits

Süre: 107 dk.

Yapım: Avusturya, ABD

Viyana Sanat Tarihi Müzesi'nde çalışan ve sanata meraklı güvenlik görevlisi Johann ile komadaki çocukluk arkadaşını bulmak için şehre gelen Kanadalı Ann'in kesişen hikayeleri anlatılmaktadır. Şehrin, sanatın ve müzenin ihtişamıyla.

Her yıl yüz binlerce kişi tarafından ziyaret edilen müze, Viyana şehrinin sanatsal dokusuyla birleşerek sinemadaki yerini almıştır.



5.7. Ulusal Müze (National Gallery, 2014)

Yönetmen: Frederick Wiseman

Süre: 180

Yapım: Fransa, ABD, Birleşik Krallık

Londra'daki Ulusal Müze'nin yaklaşık 200 yıllık hikayesini anlatan muhteşem bir belgesel. Müzenin görünenin ardındaki yolculuğu anlatan film, bir mekanın portresi olmanın ötesinde kurumun işleyişini, dünya ile olan ilişkilerini, çalışanlarını, ziyaretçilerini ve eserlerini ortaya koyan bir çalışmadır.

2016 yılında dünyanın en çok ziyaret edilen müzesi olarak, bu başarısını tabi ki kamuyla gerçekleştirdiği iletişimin gücüne ve markalaşmasına bağlamak yerinde bir tespit olur. Adeta bu başarısının beyaz perdeye yansımadır.



5.8. Yeni Rijks Müzesi (Het Nieuwe Rijksmuseum, 2014)

Yönetmen: Oeke Hoogendijk

Süre: 120 dk.

Yapım: Hollanda

Dünyanın en ünlü ve en seçkin müzelerinden biri olan Amsterdam'daki Rijks Müzesi'nin renovasyonunun perde arkasını anlatan belgesel, direktörler, küratörler, politikacılar ve tasarımcıların arasındaki çatışmaların anlatıldığı dört bölümden oluşmaktadır. 1800 yılında kurulan müze Rembrandt'tan Vermeer'e kadar pek çok ünlü sanatçının eserlerine ev sahipliği yapmaktadır.

7 milyondan fazla esere ev sahipliği yapan müzenin, gerçek hikayesinin sanatla harmanlanarak filme alınması, izleyicilerden olumlu tepkiler almıştır. Filmde de anlatıldığı gibi müzeler, sahip oldukları güç ve bilinirlik nedeniyle her zaman söz sahibi olanların, müdahale alanları da olacaklardır.



6. SONUÇ

Günümüzde müzeler, ilham perilerinin tapınakları olmaktan çıkıp, modern dünyanın kültür-sanat pazarı içinde çok önemli iletişim durakları haline gelmişlerdir. Bu mekanların çehresinin değişmesinde yeni iletişim biçimlerinin ve teknolojilerinin etkisi çok fazladır. Aslında Rönesans'la birlikte başlayan bu değişim günümüzde müzelerin gerçek bir enformasyon merkezi haline gelmelerine zemin hazırlamıştır. İster politik nedenlerle olsun, ister gerçek sanat severlerin çabalarıyla, isterse de müze sponsorlarının güçleriyle fark etmez, müzeler, toplumların kültürel sürekliliğinde bel kemiği olmuşlardır.

Yerel olmanın ötesine geçen müzeler, artık profesyonel birer şirket durumundadır. Gail ve Barry Lord gibi isimler, müze kurma konusunda profesyonel çalışmalar yapmaktadırlar. Madencilik devi Guggenheim ailesi, dünyanın her yerinde müze kurarak bir markaya dönüşmüşlerdir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Müzeler artık gündelik yaşam dinamikleri içinde, sosyal aktivitelerin gerçekleştiği mekanlardır. Sergiler, sosyal yaşamın içine yerleşmiştir. İnsan ve mekan eskisi gibi birbirine uzak değildir. Alternatif eğlence mekanlarıdır artık. Popüler iletişimin mekanlarıdır da diyebiliriz rahatlıkla.

Bu değişim sürecinin arkasında müzelerin komuoyunda bilinirliklerini arttırmaları, markalaşmaları ve evrensel olma gayretleri yer almaktadır. Sadece popüler alanlar olarak kalmayıp, güven duyulan ve başarılı işler beklenen kurumlar başlığı altındadır müzeler. İtibar ve markalaşma süreçleri içinde doğru kitle iletişim araçlarını seçerek ve doğru kullanımın planlanmasıyla görünürlükleri bu kurumlara prestij sağlamaktadır.

Sinema, müzelerin çağdaş yüzlerini yansıtmak için başvurdukları çok önemli bir iletişim teknolojisidir. Sinemanın, iletişim aracı olmasının yanında, sanatın en güçlü dallarından biri olması, sanat mekânlarının anlatım ve gösterim dilini oluşturmada büyük avantaj sağlamaktadır. Toplumdaki farklı kültürlerle çevrelenmiş insan topluluklarını dil, din, ırk ayrımı yapmaksızın ortak noktada toplama gücüne sahip tek unsur sanattır. Sinema da bu gücünü fazlasıyla ve ihtişamla kullanmaktadır. Yerelden küresele geçiş sürecinde müzeler için önemli bir avantajdır. Marka gücüyle birleştirildiğinde sinema, sınırsız anlatım ve aktarım olanağı sağlar. Müzelerle sinemanın dansı günümüze kadar başarıyla gerçekleşmiştir, gelecekte de bu görsel haz kitleleri büyülemeye devam edecektir

KAYNAKÇA

- Artun, A. (2006) “Sanat Müzeleri 1 Müze ve Modernlik”, İstanbul: İletişim Yayınları.
- Atagök, T. (2012) “Müzelerin Anlaşılır Kılınması: Müze Mimarisi, İç Mekân Ve Sergi Tasarımları”, Müzebilimin ABC’si, İstanbul: Ege Yayınları.
- Bauman, Z. (2006) “Küreselleşme, Toplumsal Sonuçları”, İstanbul: Ayrıntı Yayınları.
- Bordwell D.&Thompson K. (2008) “Film Sanatı”, Çev. Ertan Yılmaz& Emrah Suat Onat, Ankara: De Ki Basım Yayım.
- Elden, M. (2009) “Reklam ve Reklamcılık”, İstanbul: Say Yayınları.
- Erbay, F. (2002) “Müze Erişebilirliğinde Tanıtım ve Reklamın Önemi”, Müzecilik Semineri Bildiriler, 25-27 Eylül 2002, İstanbul: Askeri Müze Yayınları.
- Erkan, G. (2014) <http://mmkd.org.tr/zamanin-mekanlari-muzeler/> (17.09.2018)
- Erhat, A. (2011) “Mitoloji Sözlüğü”, İstanbul: Remzi Kitabevi.
- Güvenç, B. (1997) “Kültürün Abc’si”, İstanbul: Yapı Kredi Yayınları.
- Ilıcak Aydınalp, Ş. G. (2010) “Mükemmel Halkla İlişkiler Değişkenleri Bağlamında Türkiye’de Müze Halkla İlişkileri”, Doktora Tezi, Marmara Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, İstanbul.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

İnel, B. (2001) “Çağdaş Müzeciliğin Temel Yapısı”, 5. Müzecilik Semineri Bildiriler, 20-22 Eylül 2000, İstanbul: Askeri Müze Yayınları.

Karadeniz, C, “Müzenin Toplumsal İşlevleri Bağlamında Türkiye’deki Devlet Müzeleri İle Özel Müzelerde Çalışan Uzmanların Kültürel Çeşitlilik ve Müzenin Ulaşılabilirliğine İlişkin Görüşlerinin Değerlendirilmesi”, Uluslararası Sosyal Araştırmalar Dergisi, 35:405-422.

Karpat Aktuğlu, I (2008) “Marka Yönetimi Güçlü ve Başarılı Markalar İçin Temel İlkeler”, İstanbul: İletişim Yayınları.

Macleod, R. (2004) “İskenderiye Kütüphanesi: Antik Dünya’nın Öğreti Merkezi”, Çev.Elif Böke, Ankara: Dost Yayınları.

Özön N. (2008) “Sinema Sanatına Giriş”, İstanbul: Agora Kitaplığı.

Rentschler, R.&Hede A.M. (2007) “Museum Marketing Competing In The Global Marketplace”, UK: Elsevier.

Rona, Z. (1997) “Eczacıbaşı Sanat Ansiklopedisi”, İstanbul: Yapı-Endüstri Merkezi Yayınları.

Runyard, S. (1999) “Marketing and Public Relations Handbook for Museums, Galleries, and Heritage Attractions”, UK: The Stationery Office.

Schubert, K. (2000) “The Curator’s Egg; The Evolution of the Museum Concept from the French Revolution to the Present Day”, London: One-Off Press.

Sözcü Gazetesi (2017) <http://www.sozcu.com.tr> (18.11.2018).

Tuna, S. (2012) “Toplumsal Bellek Çerçevesinde Türk Arkeoloji Belgesellerinde İnsan-Mekan İlişkisi” Doktora Tezi, İstanbul Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, İstanbul.

Uralman, H. (2012) “Müze Halkla İlişkilerinin Genişleyen Perspektifi” Müze Bilimin ABC’si, İstanbul: Ege Yayınları.

**DEVRE KESİCİ UYGULAMASININ PİYASA VOLATİLİTESİ ÜZERİNE ETKİSİ: BORSA
İSTANBUL UYGULAMASI**

Doç.Dr Sibel ÇELİK*

Doç.Dr Yasemin Deniz KOÇ**

Dr. Öğr. Üyesi Ferit KARAHAN***

ÖZET

Devre kesici uygulamalar Borsa İstanbul' da yer alan işlemleri ve piyasadaki manipülasyonu önlemek amacıyla kullanılan bir teknolojidir. Bu çalışmada, otomatik seans durdurma sistemi ya da devre kesici uygulamasına geçilmesinin Borsa İstanbul Hisse senedi piyasası volatilitesi üzerindeki etkisi araştırılmıştır. Öncelikle BIST Tüm endeksinin volatilitesi AR(1)-GARCH(1,1) modeli ile tahmin edilmiştir. Sonrasında uygulamanın volatilité üzerindeki etkisi OLS tahmincisi ile tahmin edilmiştir. Sonuç olarak, otomatik seans durdurma sisteminin Borsa İstanbul Hisse Senedi Piyasasında volatilitéyi hem yükselen piyasa hem de düşen piyasa koşullarında aynı oranda düşürücü etki yaptığı gözlenmiştir.

Anahtar Kelimeler: Devre Kesici Sistem, Borsa İstanbul, Volatilité

1.GİRİŞ

Dünyada faaliyet gösteren menkul kıymet borsaları yatırımcılarının korunması amacını gözetmek zorundadır. Bu amaçla piyasa katılımcılarına gelen bilgi dağılımı ve eşitliği önemlidir. Eğer doğru bir bilgi herhangi bir kişiye veya bir kitleye kamuya açıklanandan farklı şekilde yansıtılırsa piyasa da manipülatif işlemler yer alır ve bu işlemlerin neticesinde menkul kıymet piyasaları, etkin bir piyasa olmaktan uzaklaşarak güven faktörü zedelenir. Benzer şekilde içeriden öğrenenlerin ticaretinin de bir piyasa işleyişine yansması olumsuz olarak görülmektedir. Bu yüzden de piyasa gözetimci, piyasa yapımcıların ve piyasada var olan her bir aktörün piyasa gözetiminde aktif görevleri bulunmaktadır. Bu doğrultuda piyasaların açık, düzenli ve dürüst çalışmasının sağlanması açısından piyasa gözetim faaliyetlerinin taşıdığı önem ulusal ve uluslararası piyasalardaki gelişmeler ve teknolojik yenilikleri dikkate almak zorunda olup bununla birlikte piyasa yapımcılar, düzenleyici ve denetleyici kurumlarla koordineli çalışması zorunluluğu vardır. (BİST)

* Dumlupınar Üniversitesi, Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Sigortacılık ve Risk Yönetimi , Kütahya/ Türkiye

** Dumlupınar Üniversitesi, Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Bankacılık ve Finans , Kütahya/ Türkiye

*** Dumlupınar Üniversitesi, İktisadi İdari Bilimler Fakültesi, Uluslararası Ticaret ve Finans , Kütahya/ Türkiye

Borsa İstanbul' da yer alan işlemler konu alındığında borsanın izlenmesi gözetimi ve denetim ile bir çok farklı düzlemde uygulamalar yer almaktadır. Bu bağlamda önceki ismi ile otomatik seans durdurma sistemleri, yeni adıyla devre kesici uygulamalar piyasadaki manipülasyonu önlemek amacıyla kullanılan bir teknolojidir. 10 Ocak 2011 tarihinde devreye alınan Borsa İstanbul Otomatik Seans durdurma sistemi hisse senetleri piyasasında ortaya çıkan anormal hareketler ile alakalı olarak yatırımcıların dikkatini çekerek onları uyarmak amacıyla geliştirilmiştir.

10 Ocak 2011 tarihinde devreye alınan Borsa İstanbul Otomatik Sıra Durdurma Sistemi, Pay Piyasasında ortaya çıkan anormal hareketler konusunda yatırımcıların dikkatini çekerek tedbirli davranmalarını temin etmek amacıyla geliştirilmiş olup iki aşamalı olarak tasarlanmıştır. Otomatik Seans Durdurma Sistemi (OSDS) BISTECH geçişi ile birlikte 30/11/2015 tarihinden itibaren yürürlükten kaldırılmış, yerine devre kesici uygulaması getirilmiştir. (BİST)

Devre Kesici Uygulaması uygulaması ile bir sermaye piyasası aracında işlemler seansın sürekli işlem bölümünde çok fiyat yöntemi ile yürütülürken belirli bir referans değer üzerinden hesaplanan fiyat değişiminin Borsa tarafından belirlenmiş olan eşik değerlere (oranlara) ulaşması veya aşması hâlinde ilgili sermaye piyasası aracının işlemleri geçici süre ile emir toplama aşamasına alınır. İlgili sermaye piyasası aracında tek fiyat yöntemi kullanılarak fiyat belirlenmesi yapılır. Tek fiyat yöntemine ilişkin süreçlerin tamamlanmasının ardından ilgili sermaye piyasası aracının işlemleri yeniden seansın sürekli işlem bölümüne alınır ve işlemlere çok fiyat yöntemi ile devam edilir. (Borsa İstanbul)

Bu çalışmanın amacı Borsa İstanbul' da devre kesici uygulamasının piyasa volatilitesine etkisini 2003-2018 dönemi için test etmektir. Bu amaç doğrultusunda çalışma girişi takiben, ikinci bölüm literatür özeti, üçüncü bölüm veri ve metodoloji, dördüncü bölüm ampirik bulgular ve beşinci bölüm sonuç olmak üzere beş bölümden oluşmaktadır. Devre kesici fiyat uygulaması ve etkilerine yönelik ulusal literatürde herhangi bir çalışmanın olmaması çalışmanın özgünlüğü ve literatüre katkısıdır.

2.LİTERATÜR

Dünyada devre kesici uygulamaları ile alakalı yapılmış bir çok çalışma bulunmaktadır. Colesanti(2010) yaptığı çalışmasında devre kesici uygulamalarının gerekliliği üzerinde durarak, geçmişte bu uygulamaların var olması halinde piyasaların krizlere daha sağlam bir duruş sergileyebileceği konusuna vurgu yapmıştır. Örnek olarak 1929 Ekonomik buhranını ifade ettiği çalışmasında bu uygulamaların kurgulanabilirliğini ve gerekliliğini düzenlemeler ve eğitim açısından ele almıştır. Çalışmada Amerikan piyasalarında yer alan DJIA VE NYSE RULE 80B devre kesici uygulamalarını kapsamlı bir şekilde ele almıştır.

Subrahmanyam (1994) çalışmasında devre kesici uygulamalarının ön etkilerini incelemiştir. Bu çalışmada zaman içerisinde devre kesicilerin fiyat değişkenliklerinin artmasına ve fiyat hareketlerinin daha da kötüleşebileceğine işaret etmiştir. Devre kesici uygulamalarının baskın ve uydu Pazar olarak iki etkileşimi ele alınan çalışmada baskın pazardan (daha fazla likiditeye sahip) uydu pazara geçiş sonrasında fiyatlar baskın pazarda azalmakta uydu pazarda ise artmakta olduğu bulgusuna ulaşılmıştır.

Ackert vd (1997) ise çalışmalarında devre kesici uygulamalarının piyasa volatilitesindeki rolünü incelemiştir. CME emtia piyasasında yaptıkları çalışmasında s&p 500 endeks future sözleşmelerinin devre kesici uygulamasından nasıl bir etkiye sahip olduğunu incelemiştir. Bu çalışma sonucunda devre kesici uygulamalarının volatilité üzerinde herhangi bir etkiye sahip olmadığı sonucuna ulaşmışlardır. Buna benzer olarak Santoni ve Liu (1993) volatilité üzerinde devre kesicilerin bir etkisi olmadığı sonuca ulaşan bir diğer çalışmadır.

Literatürde devre kesici uygulamalarının volatilitéyi düşürdüğü sonucuna ulaşan çalışmalarda bulunmaktadır. Ma vd(1989a,1989b) çalışmalarında bu araçların volatilitéyi düşürdüğü sonucuna ulaşmışlardır. Kuhn vd (1990) ve Mc Millan(1990) çalışmalarında devre kesici uygulamalarının piyasa volatilitesini artırdığı bulgusuna ulaşmışlardır.

Greenwald ve Stein(1991) çalışmalarında devre kesicilerin piyasaların etkinliğini artırıcı bir etken olduğunu savunarak volatilitéyi emen bir yapı oluşturduğuna dikkat çekmişlerdir. Piyasalarda hacim şoklarının bu tür araçlarla durdurularak oluşan suni volatilitenin durdurulması konusunu 1987 krizi bağlamında incelemiştir.

Goldstein vd(1998) çalışmalarında hem parametrik hemde parametrik olmayan yöntemlerle NYSE80A devre kesicisi üzerinde volatilité arttırıcı etkisi olup olmadığını araştırmıştır. Araştırma sonucunda küçük ama anlamlı bir volatilité arttırıcı sonuca ulaşmışlardır.

3. VERİ ve YÖNTEM

Bu çalışmada, otomatik seans durdurma sistemi ya da devre kesici uygulamasına geçilmesinin Borsa İstanbul Hisse senedi piyasası volatilitesi üzerindeki etkisi araştırılmıştır. Çalışmada kullanılan veriler Borsa İstanbul Tüm Endeksi (BIST Tüm)'ne ait 11.04.2003 ile 26.09.2018 tarihleri arasındaki günlük kapanış fiyatlarıdır. Toplam gözlem sayısı 3887'dir.

Çalışmada BIST Tüm Endeksi getirileri Eşitlik-1'de yer alan formül yoluyla hesaplanmıştır.

$$r_t = \ln(p_t) - \ln(p_{t-1}) \quad (1)$$

Getiri serilerinin durağanlığı araştırılmış ve ADF birim kök testi sonucunda durağan olduğu tespit edilmiştir. Sonraki aşamada BIST Tüm Endeksinin volatilitesi AR(1)-GARCH(1,1) modeli ile tahmin edilmiştir.

GARCH modelleri, ARCH modellerinin genişletilmiş halidir ve koşullu varyansın hata terimlerinin gecikmeli değerlerine ilave olarak, kendi gecikmeli değerlerine de bağlı olduğunu ifade eder (Bollerslev, 1986). GARCH modeline ilişkin ortalama ve varyans denklemleri sırasıyla Eşitlik-2 ve Eşitlik-3'de verilmiştir.

$$r_t = \alpha_0 + \alpha_1 r_{t-1} + \varepsilon_t \quad (2)$$

$$h_t = \beta_0 + \beta_1 \varepsilon_{t-1}^2 + \beta_2 h_{t-1} \quad (3)$$

$$\beta_0 > 0, \beta_1 \geq 0, \beta_2 \geq 0 \text{ ve } \beta_1 + \beta_2 < 1.$$

Volatilite tahmini sonrası, devre kesici uygulamalarının volatilite üzerindeki etkisini test etmek amacıyla, uygulamanın geçerli olduğu günleri ifade eden bir kukla değişken oluşturulmuştur. Otomatik seans durdurma sistemi uygulaması ilk kez 10 Ocak 2011 tarihinde başlamıştır. Kukla değişken (D), uygulamanın geçerli olduğu 10 Ocak 2011 sonrası günlerde 1, öncesi günlerde ise 0 değerini almaktadır. Otomatik seans durdurma sisteminin volatilite üzerinde etkili olup olmadığını test etmek amacıyla Eşitlik-4'de verilen model En Küçük Kareler (OLS) ile tahmin edilmiştir.

$$\text{Volatilite} = \delta_0 + \delta_1 D_t + \varepsilon_t \quad (4)$$

Sonraki aşamada ise, araştırmada belirlenen gözlem dönemi için piyasa, düşen ve yükselen piyasa olarak ikiye ayrılmış, pozitif getirilerin olduğu günler yükselen, negatif getirilerin olduğu günler ise düşen piyasa olarak adlandırılmıştır. Bu yolla yükselen piyasa kukla değişkeni (UP) ve düşen piyasa kukla (DOWN) değişkenleri oluşturulmuştur. UP değişkeni, pozitif getirilerin olduğu günler 1, diğer günler 0; DOWN ise negatif getirilerin olduğu günler 1, diğer günler 0 değerini alan iki kukla değişkendir. Devre Kesici sisteminin düşen mi yoksa yükselen piyasada mı etkili olduğunu test etmek amacıyla Eşitlik-5'de yer alan model OLS yardımıyla tahmin edilmiştir.

$$\text{Volatilite}_t = \gamma_0 + \gamma_1 \text{UPD}_t + \gamma_2 \text{DOWND}_t + \varepsilon_t \quad (5)$$

4.BULGULAR

BIST Tüm Endeksi getiri serisi ADF Birim Kök testi sonucunda durağan bulunmuştur. Öncelikle ortalama modeli belirlenmiş ve AR(1) modeli en uygun model bulunmuştur. Sonraki aşamada seride ARCH etkisinin varlığı test edilmiştir. Sonuçlar Tablo.1'de verilmiştir.

Tablo.1. ARCH Etkisinin Test Edilmesi

| Ho:Seride ARCH Etkisi Yoktur | İstatistik | Olasılık |
|-------------------------------------|-------------------|-----------------|
| F-statistic | 55.4939 | 0.0000 |
| Obs*R-squared | 259.3300 | 0.0000 |

BIST Tüm getiri serisinde ARCH etkisinin olmadığı yönündeki boş hipotez % anlam düzeyinde reddedilmektedir. Sonraki aşamada volatilité AR(1)-GARCH(1,1) modeli ile tahmin edilmiştir. Sonuçlar Tablo.2'de verilmiştir.

Tablo.2. AR(1)-GARCH(1,1) Tahmin Sonuçları

| | GARCH(1,1) |
|--------------------------|------------|
| Ortalama Denklemi | |
| α_0 | 0,0011*** |
| α_1 | 0,0216 |
| Varyans Denklemi | |
| β_0 | 0,0000*** |
| β_1 | 0,1014*** |
| β_2 | 0,8647*** |

Not:*** %1 anlam düzeyinde anlamlılığı ifade eder.

AR(1)-GARCH(1,1) model sonuçlarında katsayılar tüm kısıtları karşılamaktadır. $\beta_0 > 0$
 $\beta_1 \geq 0$ $\beta_2 \geq 0$ ve $\beta_1 + \beta_2 < 1$. Volatilité modellemesinden sonra hatalarda ARCH etkisi tekrar araştırılmıştır. Sonuçlar Tablo.3'de yer almaktadır.

Tablo.3. ARCH Etkisinin Test Edilmesi

| Ho:Seride ARCH Etkisi Yoktur | İstatistik | Olasılık |
|------------------------------|------------|----------|
| F-statistic | 0.6503 | 0.6612 |
| Obs*R-squared | 3.2541 | 0.6609 |

Tablo.3 sonuçlarına göre hatalarda ARCH etkisi görülmemektedir.

Otomatik seans durdurma sisteminin volatilité üzerindeki etkisini test etmek için Eşitlik-4 tahmin edilmiştir. Bulgular Tablo.4'te yer almaktadır.

Tablo.4. Regresyon Tahmin Sonuçları

| | Katsayı | t-istatistiği |
|----------------------------|--------------|---------------|
| δ_0 | 0.0003*** | 20.2414 |
| δ_1 | -0.000113*** | -6.1830 |
| Düzeltilmiş R ² | 0.0768 | |
| F İstatistiği | 324.52 | |
| Olasılık | 0.0000 | |

Not: Tablo.4'de yer alan bulgular, Eşitlik-4'de verilen

$$Volatilité = \delta_0 + \delta_1 D_t + \varepsilon_t \text{ modelinin tahmininden elde edilmiştir.}$$

Regresyon tahmin sonuçlarında serisel korelasyon ve değişen varyans problemi görülmüş, Newey-West HAC yöntemi ile tutarlı standart hatalar hesaplanmıştır.

Tablo.4'teki sonuçlarda otomatik seans durdurma sistemine geçişin volatilité üzerinde negatif ve istatistiksel olarak anlamlı etkisi olduđu görülmektedir. δ_1 kukla deđişken katsayısı negatif ve anlamlıdır. Bu durumda otomatik seans durdurma sistemine geçişin piyasa volatilitésini anlamlı ölçüde düşürdüđu söylenebilir.

Devre Kesici sisteminin düşen ya da yükselen piyasada mı etkili olduđunu test etmek amacıyla tahmin edilen Eşitlik-5'de verilen model tahmin sonuçları Tablo.5'de yer almaktadır.

Tablo.5. Regresyon Tahmin Sonuçları

| | <i>Katsayı</i> | <i>t-istatistiđi</i> |
|----------------------------|----------------|----------------------|
| γ_0 | 0.0003*** | 20.2388 |
| γ_1 | -0.000112*** | -6.1375 |
| γ_2 | -0.000113*** | -6.0372 |
| Düzeltilmiş R ² | 0.0771 | |
| F İstatistiđi | 162.22 | |
| Olasılık | 0.0000 | |

Not: Tablo.5'de yer alan bulgular, Eşitlik-5'de verilen

$Volatilite_t = \gamma_0 + \gamma_1UPD_t + \gamma_2DOWND_t + \varepsilon_t$ modelinin tahmininden elde edilmiştir.

Regresyon tahmin sonuçlarında serisel korelasyon ve deđişen varyans problemi görülmüş, Newey-West HAC yöntemi ile tutarlı standart hatalar hesaplanmıştır.

Tablo.5' de yer alan sonuçlara göre yükselen piyasa ve düşen piyasa katsayıları birbirine çok yakındır. Bu bulgulardan çıkırlacak sonuç, otomatik seans durdurma sisteminin düşen ve yükselen piyasalarda aynı derece volatilité üzerinde düşürücü etkiye sahip olduđunu göstermektedir.

5.SONUÇ

Bu çalışmada, otomatik seans durdurma sistemi ya da devre kesici uygulamasına geçilmesinin Borsa İstanbul Hisse senedi piyasası volatilitésini üzerindeki etkisi araştırılmıştır. Öncelikle BIST Tüm endeksinin volatilitésini AR(1)-GARCH(1,1) modeli ile tahmin edilmiştir. Sonrasında uygulamanın volatilité üzerindeki etkisi OLS tahmincisi ile tahmin edilmiştir. Sonuç olarak, otomatik seans durdurma sisteminin Borsa İstanbul Hisse Senedi Piyasasında volatilitéyi hem yükselen piyasa hem de düşen piyasa koşullarında aynı oranda düşürücü etki yaptıđı gözlenmiştir.

KAYNAKLAR

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Bollerslev, Tim (1986), "Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity", *Journal of Econometrics*, Vol. 31, pp.307–327.

Ackert, L.F., Hao, J. & Hunter, (1997) "The Effect of Circuit Breakers on Expected Volatility: Tests Using Implied Volatilities" *W.C. Atlantic Economic Journal* 25: 117.
<https://doi.org/10.1007/BF02298379>

Goldstein, Michael A. (1998) "Circuit Breakers, Volatility, and the U.S. Equity Markets: Evidence from NYSE Rule 80A", t.y., New York, Oxford University Press, s.3.

Greenwald, Bruce C.; Stein, Jeremy C. (1991) "Transactional Risk, Market Crashes, and the Role of Circuit Breakers," *Journal of Business*, 64, 4: 443–62.

Kuhn, Betsey A.; Kuserk, Gregory J.; (1990) Locke, Peter. "Do Circuit Breakers Moderate Volatility? Evidence from October 1989," working paper, Washington, DC: United States Department of Agriculture.

Ma, Christopher K.; Rao, Ramesh P.; (1989) Sears, R. Stephen. "Limit Moves and Price Resolution: The Case of the Treasury Bond Futures Market," *Journal of Futures Markets*, 9, (4): 321–35.

McMillan, Henry. (1990) "Circuit Breakers in the S&P 500 Futures Market: Their Effect on Volatility and Price Discovery in October 1989," Working Paper, Washington, DC: Office of Economic Analysis, U.S. Securities and Exchange Commission.

Santoni, G. J.; Liu, Tung. (1993) "Circuit Breakers and Stock Market Volatility," *Journal of Futures Markets*, 13, (3): 261–77.

Subrahmanyam, Avanidhar. (1994) "Circuit Breakers and Market Volatility: A Theoretical Perspective," *Journal of Finance*, 49, (1): 237–54.

<http://www.borsaistanbul.com/urunler-ve-piyasalar/piyasalar/pay-piyasasi/devre-kesici>

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES
November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey
GÜNEY KORE, JAPONYA ve TÜRKİYE'DE ENERJİ POLİTİKASININ BİR UNSURU
OLARAK ENERJİ KAYNAKLARININ KULLANIMI

Sıtkı Selim DOLANAY*
Latif Onur UĞUR**
Bekir Sami OĞUZTÜRK***

ÖZET

1970'li yılların tecrübeleri enerji ekonomisi bilim dalını ortaya çıkarırken, aynı zamanda ülkelerin enerji politikalarında köklü değişikliklere gitmelerine yol açmıştır diyebiliriz.

Dünya genelinde 1970'li yıllarda yaşanmış olan iki petrol krizi sonrasında ülkeler, alternatif enerji kaynaklarından yararlanma yoluna giderek, birincil enerji arzında kaynak çeşitlendirmesi sağlamaya çalışmışlardır. Amaç ise petroldeki ani fiyat yükselişlerinin etkisinden kendi ülke sanayilerini korumak ve birincil enerji arz güvenliğini sağlamak olmuştur. Son yıllarda kaynak çeşitlenmesine gidilirken petrole alternatif kaynakların çevresel etkileri göz önüne alınır olmuştur. Bu bağlamda yenilenebilir enerji kaynaklarından artan oranda yararlanılma yoluna gidilmeye başlanmıştır. Uzun yıllardır enerji elde etmede kullanılan su gücüne ek olarak, rüzgar ve güneş enerjisi, jeotermal enerji ve biyokütle enerjilerinden de yararlanılmaya başlanmıştır. Böylece dünyada enerji politikasının önemli bir unsuru petrole bağımlılığı azaltarak alternatif enerji kaynaklarına yönelme amacı olmuştur. Bu amaç çerçevesinde petrol gibi diğer rezervi tükenebilir fosil yakıtlara da bağımlılığı azaltabilmek önem kazanmıştır. Ancak, yenilenebilir enerji kaynaklarına ek olarak, enerji elde edilmesinde doğal gaz ve nükleer güç santrallerinden de yararlanılmaya artan bir hızla devam edilmiştir. Ele aldığımız ülkeler olan Güney Kore ve Japonya enerji teminin de nükleer güç santrallerine önem vermişlerdir. Türkiye ise 1970'lerdeki petrol krizlerinden sonra enerji temininde kaynak çeşitlendirmesine gitmiş olmasına karşın, ithal fosil yakıt bağımlılık yüksek düzeyde kalmaya devam etmiştir Zira Türkiye petrol yerine başka bir fosil yakıt türü olan doğal gaza yönelmeye başlamış, böylece petrole bağımlılık azalırken, doğal gaza bağımlılık artmıştır. Türkiye'de 2000'li yıllardan itibaren politika değişikliğine gidilerek yenilenebilir enerji kaynaklarına ve nükleer santrallerin kurulmasına yönelmeye başlanmıştır.

Anahtar Kelimeler: petrol, petrol krizi, doğal gaz, birincil enerji arzı, birincil enerji talebi, enerji kullanımı

Jel Kodları: N70, Q38, Q43

USE OF ENERGY RESOURCES AS AN ELEMENT OF ENERGY POLICY IN SOUTH

* Dr. Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat, selimdolanay@hotmail.com, Ankara, Türkiye

** Dr Öğretim Üyesi, Düzce Üniversitesi Teknoloji Fakültesi, İnşaat Mühendisliği, latifugur@duzce.edu.tr, Düzce, Türkiye

*** Doç. Dr., Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat, bekiroguzturk@sdu.edu.tr, Isparta, Türkiye

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

KOREA, JAPAN and TURKEY

ABSTRACT

While the experience of the 1970s led to the discovery of energy economics, we can also say that countries have led to radical changes in energy policies.

After two oil crises in the 1970s, countries have sought to utilize alternative energy resources and have sought to diversify their primary energy supply. The aim was to protect their own countries' industries and to ensure the security of primary energy supply from the impact of sudden price increases in oil. In recent years, diversification of resources has taken into account the environmental impacts of alternative sources of oil. In this context, renewable energy resources have been increasingly utilized. In addition to the water power used to obtain energy for many years, wind and solar energy, geothermal energy and biomass energy have also been utilized. Thus, an important element of the energy policy in the world has been the aim of turning to alternative energy sources by reducing dependence on oil. For this purpose, it is important to reduce the dependency on fossil fuels such as oil, which can be consumed in other reserves. However, in addition to renewable energy sources, the utilization of natural gas and nuclear power plants has been continued at an accelerating rate. South Korea and Japan, which we are concerned about, have given importance to nuclear power plants. If Turkey Although gone to diversify sources of energy supply after the oil crisis of the 1970s, has continued to be imported fossil fuel dependency at a high level since Turkey began to turn to natural gas, another fossil fuels instead of oil, so oil dependency decreases, increased dependence on natural gas. by navigating to policy changes in Turkey since the 2000s it has begun to shift to renewable energy sources and the establishment of nuclear power plants.

Keywords: *Oil, Oil Crisis, Natural Gas, Primary Energy Supply, Primary Energy Demand, Energy Use*

Jel Codes: *N70, Q38, Q43.*

1.GİRİŞ

Enerji tarihine baktığımızda, ilk insanların aydınlatma ve ısınmada ateşten yararlandıklarını görürüz. Tarımsal faaliyetlerin ve hayvancılığın yaklaşık 10.000 yıl önce başlamasıyla, insanlar kendileri ve hayvanları için tarımsal ürünleri ekip biçmeye başlamışlardır. Daha fazla enerji ihtiyacı ortaya çıktıkça, insanlar yeni makine ve teçhizatlar yapmaya başlamışlardır. Önce ihtiyaçtan fazla yetiştirilmiş tarımsal ürünlerin, bir yerden diğerine nakli için suda yüzen araçlar ve su gücünden yararlanmak için değirmenler yapmışlardır. Örneğin 1086 yılında İngiltere'de 5,624 değirmen tespit edilmişken, sayının Fransa için 1700 yılında 100.000 adedi bulunduğu anlaşılmıştır. (Ausubel, 2000: 1)

1000'li yıllarda enerjinin verimsiz kullanımı çok büyük masrafları da beraberinde getirmiştir. Örneğin baca sisteminin bulunuşu öncesinde, evlerde, odanın ortasına ateş yakılır ve dumanın sorun oluşturmasını önlemek için çatı yüksek yapılır ve dumanı çekmesi için ağaç kullanılırdı. Bu dönemde ateş elde edilmesinde çok fazla odun kullanılmış olmasına karşın, 1744'te sobanın bulunuşu ile birlikte, sobayı yakmak ve ateşin devam etmesini sağlamak için gerekli odun miktarı azalmıştır. 1800'lü yıllarda kömürün yeni bir enerji kaynağı olarak bulunuşu ile birlikte, petrolün bulunuşuna kadar hakim enerji kaynağı olmuştur. 1800'lerde enerji kaynağı olarak kömürün kullanılmaya başlamasıyla birlikte şehirler gelişmeye ve şehirlerdeki sosyal yapı karmaşıklaşmaya başlamıştır. 1800'ler boyunca İngiltere'de sanayi bölgelerinde nüfus yoğunluğu artmış, kişi başına enerji kullanımı yavaşça yükselmiştir. 1900'lü yıllara kadar kömür hakim enerji kaynağı olarak kalmış, ancak şehirlerde hava kirliliği ortaya çıkmış, madencilerin yaşamları olumsuz etkilenmiştir. 1900'lerde sıvı yakıtın katı yakıtlara göre üstünlükleri ortaya çıkmıştır. Petrol kömüre göre daha fazla enerji yoğunluğuna sahiptir. Başka bir deyişle aynı miktarda petrole, aynı miktarda kömüre göre daha fazla enerji elde etmek mümkündür. Petrolün boru hattı ya da tankerler yolu ile taşınması mümkündür. Depolanması ve kullanılması daha kolaydır. Dolayısıyla 1950 yılından itibaren hakim enerji kaynağı olmuştur. Doğal gaz ise petrol gibi depolanması ve boru hatlarıyla nakledilebilen bir enerji kaynağı olarak kömüre göre üstün, petrol ile yarışabilecek özelliklere sahiptir. (Ausubel, 2000: 1-2)

Dünya'da enerji tüketimi 1950'lerden itibaren ekonomik büyüme ve *nüfus artışına paralel* olarak 1970'lere kadar hızla artmış, 1970'li yıllarda yaşanan iki petrol krizi ile birlikte tüketim artış hızı yavaşlamış ve kaynak kullanımında değişiklikler olmuştur. (Bahar, 2005: 38)

Nükleer güç ise enerji elde etmede petrol ve doğal gazla göre verimliliği daha yüksek bir kaynaktır. Genel olarak araştırmalar nükleer santrallerin, kömürle çalışan santrallerden daha pahalıya elektrik ürettiğini, doğal gaz santrallerine yakın, rüzgar ve güneş enerjilerine göre daha iyi bir ekonomik performansa sahip olduğu sonucuna varmıştır. Ancak, nükleer santrallerin en büyük faydası enerji kaynaklarının çeşitlendirilmesine ve enerji arz güvenliğine olumlu katkısıdır. Kömür, petrol ve doğal gazın fiyatlarındaki dalgalanmalar enerji üretim maliyetini çok fazla etkilerken, uranyum fiyatındaki dalgalanmalar enerji üretim maliyetini fazla etkilememektedir. Nükleer enerji içinde yakıt maliyeti %5-10 civarında yer tutarken, kömür, petrol ve doğal gaz santrallerinde bu oran %55-60'lar civarına çıkmaktadır. (Köksal ve Civan, 2009: 1-2)

Nükleer santrallerin ilk kurulum maliyetleri yüksek ve işletme maliyeti diğer santrallere göre daha yüksektir diyebiliriz. Bu yüzden ekonomik ömrünü tamamlayıncaya kadar işletilmeleri önemlidir. Nitekim geçmişteki nükleer santral kazalarına karşın, nükleer santral inşası dünya genelinde sürmektedir. Bu çalışmada ele alacağımız ülkelere Japonya'da 2011 yılındaki deprem sonucunda nükleer santral arızaları yaşanmış olmasına karşın yeni santral inşasına devam edilmekte, yine Güney Kore'de de yeni santral inşaatları planlanıp gerçekleştirilmektedir. Türkiye gecikerek de olsa iki adet

nükleer santral kurulumunu planlamış ve ilki olan Mersin-Akkuyu santralının inşasına başlamıştır (World Nuclear Association). Kısaca değindiğimiz üç ülkedeki enerji kaynaklarının kullanımı konusundaki politikaları daha ayrıntılı inceleyelim;

2.GÜNEY KORE

Güney Kore'de 1880'lerden bu yana oligopol piyasalarının egemenliği söz konusudur denebilir. Piyasa'ya hakim olan bu az sayıdaki firmanın bu günkü karşılığı chaebollerdir. Chaeboller yatay genişleme yoluyla büyüyerek birbirleriyle ilgili olsun ya da olmasın pek çok alanda üretim yapan firmalardır. (Amsden, 1989: 141-155) 1963 yılından itibaren, iktisat politikası bol ve ucuz olan emek gücü ile ihracata yönelik sanayileşme stratejisine dayandırılmıştır. Ancak bu tarihten sonra yüksek ekonomik büyüme hızları yakalanabilmiştir. (Eski, 1989: 142-143) 1962-1966 arası I. Plan ve 1967-1971 arası II. Plan dönemlerinde esas olarak emek yoğun sanayilerin geliştirilmesine öncelik verilmiş, bu sanayiler için gerekli teknoloji ve sermayenin ithaline yönelime olmuştur (Eski, 1989: 16-19). 1960'larda tekstil ürünlerinin ihracı ile ihracata dayalı sanayileşme sürecine girilmiştir (Amsden, 1989: 55-73). 1972 yılında İthal İkameci Sanayileşme stratejisine geri dönülmüştür (Leipzig, 1988: 124-125). Ancak ihracat gerekliliği unutulmamış, kimi sektörlerde ihracat destekleri sürmüştür (Dolanay, 2017). Ağır sanayi, kimya, demir-çelik, metal, petro-kimya, elektronik ve gemi yapım sanayilerinin desteklenmesi planlanmış ve ağır sanayi, kimya sanayi ile tarım alanındaki yatırımlara ağırlık verilmiştir. 1980 sonrası dönemde ise seçilen piyasaların desteklenmesi politikasına geçilmiştir (Leipzig, 1988: 124-125). İhracata dayalı ekonomik büyüme modeline geri dönülmüştür (Dolanay, 2017). 1965-1975 arası dönemde işgücü yoğun tekniklerle pamuklu, tekstil ve elektronik sanayilerinde üretilen mallar ihraç edilirken, 1976'dan itibaren sermaye yoğun tekniklerle üretilen mallar ihraç edilmeye başlanılmıştır. 1960-1979 yılları arasında GSYH ortalama yıllık %8.8 oranında artmış, 1965-1973 arası dönemde GSYH büyüme hızı %9.43, enerji tüketimi artış hızı ise %9.11 olmuştur. 1973-1979 döneminde GSYH büyüme hızı %9.44, enerji tüketimi artış hızı %8.76 olmuştur. GSYH büyüme hızı tüm dönem boyunca ortalama %9.4 düzeyinde kalmıştır. (Yager, 1984: 28)

1963-1979 arası dönem boyunca GSYH hızlı ve istikrarlı bir şekilde büyümüştür. Yaşanan iki petrol krizinin ise ekonomik gelişme sürecini etkilemediği görülmektedir. (Dolanay, 1998; Dolanay ve Uğur, 2009)

1961-1979 arası dönemde GSYH toplam enerji kullanımından daha hızlı artmış ve 1979'da birim GSYİH başına yaklaşık %12.5 oranında daha az enerji tüketimi ihtiyacı doğmuştur (Yager, 1984: 28). 1974 yılında yani ilk petrol krizi yılında enerji kullanımı ancak %0.9 oranında artarken, GSYİH büyüme hızı ise %8.8 gibi yüksek bir düzeyde gerçekleşmiştir. 1979 yılında II. petrol krizi yıllarında ise enerji kullanımından fedakarlık edilmemiş GSYİH artış hızı düşük kalmış olduğu için krizin etkilerine maruz kalınmamıştır. (Yager, 1984: 27-34)

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

1973 yılına kadar olan süreçte ekonomi büyürken hem yurt içi kömür üretimi, hem de ithal petrol kullanımı sürekli artmıştır. 1973 yılına göre, 1979 yılında kömür üretimi yaklaşık %34 oranında artmış, petrol ithalatı artış oranında düşme yaşanmıştır. GSYİH çok hızlı büyümüş ve enerji ihtiyacı ithal petrol dışı kaynaklardan karşılanılmaya çalışılmıştır. Böylece ithal petrole bağımlılık azaltılmıştır. (Dolanay, 1998: 65; Dolanay ve Uğur, 2009)

1973-74 petrol krizi ile birlikte devlet yüksek ekonomik büyüme hızları sağlayacak ekonomik politikaları uygulamaya devam etmiştir. 1979 krizi yıllarında ise sadece 1980 yılında üretim azalışı yaşanmış, 1981'de tekrar yüksek büyüme hızlarına geri dönmüştür. G. Kore 1979 krizi sırasında rekabet gücü düşmesi nedeniyle 1974'deki gibi petrol fiyatlarındaki artışı ihraç ürünleri fiyatlarına yansıtamamıştır. 1979 yılında petrole bağımlılığı azaltmak için enerji tasarrufu yapılmasını ve alternatif enerji kaynaklarının geliştirilmesini içeren bir plan ortaya konulmuştur. 1980'li yıllardan itibaren G. Kore sanayileşmiş ülkeler sınıfına yükselmiş görünmektedir. (Yager, 1984: 68-70)

Güney Kore'de nükleer enerjiden yararlanmaya yönelik ilk faaliyetler 1957 yılında Uluslararası Atom Enerjisi Kurumu'nun oluşturulmasıyla başlamış, 1959 yılında Atomik Enerji Yasası kabul edilmiş ve 1959 yılında hükümet tarafından Atomik Enerji Bürosu kurulmuştur. 1962 yılında ise ufak bir araştırma ünitesi şeklinde ilk nükleer reaktör hayata geçirilmiştir. İlk nükleer güç santrali olan Kori1'in Westinghouse ünitesi ise 1977'de inşa edilmiş ve 1978'de faaliyete geçmiştir. 1980'lerin başında 8 yeni reaktörün inşasına devam edilmiştir. (World Nuclear Association) Böylece 1970'lerin hızla ekonomik büyümesini sürdüren Güney Kore ekonomisinin (Dolanay, 2017), 1980'lerde de hızlı ekonomik büyümesini (Dolanay, 2017) nükleer enerji kullanma avantajından yararlanarak devam ettirmişti diyebiliriz.

2007 yılı ekonomik büyüme hızı %5, işsizlik oranı ise %3.2 olmuştur. 2007 yılı GSYH'nın sektörel dağılımına baktığımızda; tarımın payının %3, sanayinin %39.4 ve hizmetlerinki de %57.6'dır. Bu rakamlar da bize tipik bir sanayi toplumu ekonomik yapısını işaret etmektedir. (Kore Ulusal İstatistik Enstitüsü, 2008)

2015 yılı itibariyle birincil enerji arzının %38.1'ini petrol, %15.2'sini LNG, %27.7'sini biyokütle enerjisi, %12,1'ini nükleer enerji, %2'sini antrasit ve %4.9'unu su gücü kaynağı (hidro elektrik santraller) ve yenilenebilir enerji kaynakları oluşturmuştur. 1980 yılından 2015 yılına gelinceye kadar ithal petrol bağımlılığı yaklaşık %60'lar seviyesinden, %40'lar seviyesine düşmüştür. (KEEI (Korea Energy Economics Institute), 2016: 6 ve 9)

2015 yılı itibariyle GSYH artış hızı %2.6, enerji tüketimi artış hızı ise %2.2 olmuştur. Böylece 2015 yılında ekonomik büyüme hızı enerji tüketimi artış hızının üzerinde gerçekleşmiş ve enerji verimliliği artmıştır. Aynı eğilim 1981-2015 arası tüm dönem boyunca gözlenmiştir. KEEI (KEEI, 2016: 9)

Halen Güney Kore'de 24 adet nükleer enerji reaktörü 22,505 MWe kurulu gücüyle faaliyet halindedir ve 7000 MWe kurulu güçle 5 yeni reaktörün inşası devam etmektedir. Bunlardan Shin Kori 6'nın inşasına Eylül 2018'de başlanmıştır (World Nuclear Association,2018: 4-5). Güney Kore 2011 yılında Japonya'da yaşanmış olan depremde nükleer reaktörlerin zarar görmüş olmasına karşın, nükleer reaktör inşasına devam etmiştir. Bu ise nükleer enerjinin Güney Kore için bir gereklilik olduğunu göstermiştir.

3.JAPONYA

Japonya sanayileşmesini 1868-1967 yılları arası süreçte tamamlamış ve 1967 yılında sanayileşmiş ülkeler arasına katılmıştır. 1870'li yıllarda az gelişmiş bir tarım ülkesi görünümünde olmuş olan Japonya'da, imalat sadece küçük işletmelerde yapılabilmiş ve kitlesel üretim söz konusu olmamıştır. (Sadıklar, 1971: 35). 1868 yılından 1905 yılına kadar devlet sanayi işletmelerini koruyucu politikasını sürdürmüştür (Sadıklar, 1971: 35). 1905-1930 yılları arası süreçte ekonomide kitlesel sanayi malı üretimi yaygınlaşmıştır diyebiliriz. Bu süreçte sanayinin ekonomideki ağırlığı artmış, tarım sektörünün nispi önemi azalmıştır. 1931-1938 arası yıllar hızlı ekonomik büyüme, 1939-1944 arası yıllar ise küçülme ve İkinci Dünya Savaşı nedeniyle yıkım yılları olmuştur. Bu savaş yıllarında sanayi üretiminin azalış ivmesi hızlanmıştır. Ekonomide tarım temel sektör haline gelmiştir (Sadıklar, 1971: 35-39). 1946 yılındaki sanayi üretimi 1941 yılındaki üretimin 1/7'sine kadar düşmüştür (Sadıklar, 1971: 195).

ABD işgal idaresi toprak ve eğitim reformu gerçekleştirmiş, serbest piyasa ekonomisi oluşturulmaya başlanmıştır. 1952 yılında imzalanan barış antlaşmasının yürürlüğe girişi, reformların etkisinin ortaya çıkmaya başlamasıyla birleşmiş ve Japonya için yeni bir dönem başlamıştır (Sadıklar, 1971: 7-8 ve 35-39).

Kore savaşı Japonya'da ekonomide yüksek büyüme hızlarının elde edilmesinde pay sahibi olmuştur diyebiliriz (Tsuru, 1993: 56-59). Sonraki yıllarda da hızlı ekonomik büyüme sürmüştür ve 1953-1960 yılları arası süreçte ortalama yıllık ekonomik büyüme hızı %9.5 olmuştur (Sadıklar, 1971: 39-51). Ortalama yıllık ekonomik büyüme hızı 1954-1958 yılları arası süreçte %7, 1959-1963 yılları arası süreçte %10.8 ve 1964-1968 yılları arası süreçte %10.9 olmuştur (Tsuru, 1993: 67). İkinci Dünya Savaşı'nın ardından Japon ekonomisi çok kötü bir duruma sürüklenmiş olmasına karşın, çok kısa sürede toparlanmış, yıllık iki haneli reel ekonomik büyüme hızları ile hızla gelişmiş ülkeler arasındaki yerini almıştır (Horika, 1994: 293-316).

1967-1971 yılları arasında yıllık ortalama ekonomik büyüme hızı %10.1 olmuş, ihracat artmıştır. (Sadıklar, 1971: 51-54). 1970-1974 yılları arası süreçte yıllık ortalama reel GSYH artış hızı %9,6 olmuş, ancak 1973 petrol krizinin başlamasıyla 1974'te ekonomik büyüme yaşanmamıştır. (Sadıklar, 1971: 51-54; Dolanay ve Uğur, 2018). 1960-1970 yılları arası süreçte Japon ekonomisinde yıllar itibariyle düşük

nüfus artış hızları, yüksek ekonomik büyüme oranları ile birlikte gerçekleştirilebilmiştir. GSYH 1979 yılında 1960 düzeyinin yaklaşık 3.5 katına çıkmış, nüfus artış hızı yıllık ortalama %1.1 olmuştur (Sadıklar, 1971: 35-51).

1960-1979 yılları arası süreçte hızlı sanayileşme söz konusu olmuştur. Tarım, ormancılık ve balıkçılığın GSYH içindeki payı 1960 yılında %14.3 iken, 1979 yılında %4.4'e düşmüş, imalat sanayinin payı ise %26.8'den %34.7'ye yükselmiştir (Yager, 1984: 6). Kişi başına enerji tüketimi, 1960 yılına göre 1979 yılında 3.5 kat artmıştır. (Yager, 1984: 8)

Enerji tüketimi artış hızı 1962, 1965 ve 1971 yıllarında GSYH büyüme hızının altına düşmemiştir. 1974 yılında ve özellikle de 1975 yılında enerji tüketimi bir önceki yıl rakamına göre düşüş göstermiştir. Enerji yoğunluğundaki düşüş, 1974-1979 yılları arası dönemde enerji verimliliğinin artmış olduğunu göstermiştir. 1960-1973 yılları arası dönemde ise enerji yoğunluğu artış eğiliminde olmuştur. 1960-1973 yılları arası süreçte GSYH yılda ortalama %10.5 büyümüşken, enerji tüketimi %11.8 oranında artmıştır. 1973-1979 yılları arası süreçte, GSYH yılda ortalama %4 oranında, enerji tüketimi ise %0.6 oranında artmıştır (Yager, 1984: 8). 1960-1979 yılları arası dönemin tümünde nüfus, GSYH ve enerji tüketimi sırasıyla, yılda ortalama %1.15, %8.39 ve %8.36 oranlarında artmıştır (Dolanay, 1998: 78; Dolanay ve Uğur, 2018).

1960 yılından 1973 yılına gelinceye kadar Japonya'nın toplam enerji tüketimi dört kattan fazla artmış ve yıllık enerji tüketimi artışı %10'un üzerinde gerçekleşmiştir. Yurt içi enerji üretimi enerji talebini karşılayacak düzeyde olmadığından, yurt dışından birincil enerji kaynakları olan kömür ve petrolün ithali yoluna gidilmiştir. Ancak, büyük miktarda kömür ithaline karşın 1973 yılında birincil enerji arzı içinde kömürün payı %6 düzeyinde kalmış ve birincil enerji arzı içinde ağırlıklı olarak petrol yer almıştır. (Yager, 1984: 15)

1960-1973 yılları arası süreçte enerji yoğunluğundaki artışla kömürden petrole geçiş hızlanmıştır diyebiliriz. Kömür, ucuz ve temiz olan, daha yüksek miktarlarda üretilebilen petrole rekabet edememiştir. 1960-1973 yılları arası süreçte reel enerji fiyatlarındaki %26.6 oranında düşüş görülmüştür. Böylece sanayi sektörü 1960-1973 yılları arası süreçte %340 oranında büyümüştür. Aynı dönemde sanayi sektörünün toplam enerji tüketimi içindeki payı %42,5'ten %45.7'ye çıkmış, sanayi sektörü genelinde enerji yoğunluğu artmıştır. Sanayi sektöründe enerji kullanımının büyük çoğunluğu imalat sanayi sektöründen kaynaklanmıştır. (Yager, 1984: 9-15)

1973 yılı itibariyle toplam birincil enerji arzı içinde, ithal yakıtın payı %90, ithal petrolün payı ise %77.6 olmuştur. (Yager, 184: 11)

1973 ve 1974 yıllarında yaşanmış olan ilk petrol krizi sırasında enerji tasarrufu yapılmış, enerji tasarrufu ile birlikte, çimento üretimi ve çelik sanayinde yakıt kullanımını azaltıcı teknikler uygulanmaya başlanmıştır. Ücret artışları işçi-işveren ilişkilerinin kendine özgülüğünden dolayı sınırlı

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

düzye de tutulabilmiş, daha yüksek katma değ erli sanayi ür ünü yatırımlarına öncelik verilmiş, makine, elektronik ve bilgisayar üretimi artırılma yoluna gidilmiş ve ağır sanayi ve kimya sanayi yatırımları yüksek maliyet nedeniyle kısılma yoluna gidilmiştir. Bölgeler arası gelir eşitsizliklerini azaltmak için ticaret ve hizmet sektörlerinin gelişmesini sağlayıcı önlemler alınmıştır. Esnek kur uygulamasına karşın, ihracattaki sürekli artış ise krizden kısa sürede çıkışı sağlamıştır diyebiliriz. (Tsuru, 1993; Sadıklar, 1971: 51-54)

Ayrıca birinci petrol krizinden sonra petrol stoklanmaya başlanmış, enerji alanındaki araştırma ve geliştirme faaliyetlerine kaynak ayrılmaya başlanmıştır. Enerji ihracatçısı ülkelerle diplomasi, ekonomik yardım ve yatırım alanlarında iyi ilişkiler geliştirilmeye çalışılmıştır. Devlet kriz sonrasında hızlı büyümeden ziyade istikrara ve enerji tüketimi artış hızını azaltıcı politikalara ağırlık vermiştir. (Yager, 1984: 15-19)

Birinci petrol krizi sırasında, krizden çıkılmasını sağlayacak ekonomi politikaları uygulanmış, ikinci petrol krizi sırasında ise enerji politikaları ile uyumlu ekonomi politikaları geliştirilmek suretiyle krizin etkileri daha ç abuk atlatılabilmektedir. (Dolanay, 1998: 82; Dolanay ve Uğur, 2018)

İthal yakıtın toplam birincil enerji arzı içindeki payı, 1979 yılında 1973 yılına göre azalarak %88.2 olmuş, ithal petrolün payı ise %72.8'e düşmüştür. 1973 yılından itibaren 1979 yılına gelinceye kadar alternatif enerji kaynaklarının kullanımına yönelme gerçekleşmiştir. Toplam birincil enerji arzı içinde alternatif enerji kaynaklarının üretimi, ithal alternatif kaynakların ve doğal gaz ithalinin payı artmıştır. Ayrıca sanayi sektöründe enerji tasarrufu artmıştır (Dolanay, 1998: 82; Dolanay ve Uğur, 2018).

İkinci petrol krizi ile birlikte de sıkı para politikası uygulanmaya başlanmış, petrol ithalatı azaltılmaya çalışılmış, imalat sanayi enerji tüketimleri düşmüş, yani verim artışları sağlanmıştır. İmalat sanayi enerji tüketimleri, 1973 yılı 100 kabul edilirse 1977'de 90'a, 1980 de 73'e ve 1982'de de 63'e düşmüştür. Yoğun bilgi ve ileri teknoloji kullanan sektörler sanayi üretiminde ön plana çıkmaya başlamıştır diyebiliriz. (Tsuru, 1993; Sadıklar, 1971: 51-54).

1980'li yıllarda uygulanmış olan ekonomi politikaları ile iç talebe yönelik üretim artmaya başlamış, ihracat ve dış ticaret fazlası azalmaya başlamış ve ekonominin ihracata bağımlı yapısı değişmeye başlamıştır. Madencilik ve sanayi sektörleri üretimi, 1985 yılında 1950 yılına göre 45 kat artmıştır (Sadıklar, 1971: 55-78). Japon sanayi devrimi üzerinde ithal enerjiye bağımlılık, işçi verimliliğindeki artış, araştırma ve geliştirmeye verilen önem, teknoloji alış veriş i ile yeni teknolojilerin bulunması etkili olmuştur diyebiliriz (Sadıklar, 1971: 55-78).

1950'lerdeki hızlı sanayileşme sürecinde enerji kaynağı olarak büyük oranda petrol kullanılmış ve böylece ithal petrole bağımlılık artmaya başlamıştır. İlk petrol krizi sonrasında alternatif enerji kaynaklarına yöneliş başlamış ve 1980'lerde ithal petrole bağımlılık %70'ler düzeyinden %60'lar düzeyine düşürülebilmektedir. (The World Bank, 1995: 162-225). 1973 yılında birincil enerji kaynakları

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

içinde petrolün payı %77.9 olmuş iken, 1995 yılında %54.2'ye düşmüştür. Aynı yıllar için nükleer enerjinin payı %0.8'den %15.3'e çıkmış, doğal gazın payı %1.6'dan %10.5'e yükselmiştir (Yager, 1984: 49-50).

Japonya'da enerji krizinin etkilerinden kurtulabilmek için ithal petrole bağımlılık azaltılmış, nükleer enerji ve doğal gaz kullanımına yönelim gerçekleştirilerek kaynak çeşitlenmesi sağlanmıştır. (International Energy Agency, 1997: 130-133). 1994 yılında GSYH'dan tarım sektörü %2, sanayi sektörü %40 ve hizmetler sektörü %58 pay almıştır (The World Bank 1996: 188-222). 1995 yılında ise GSYH'dan tarım sektörü %2, sanayi sektörü %38 ve hizmetler sektörü ise %60 oranında pay almıştır (The World Bank 1997: 214-237). 1996 yılı ile birlikte düşük ekonomik büyüme temposu oluşmuş, ardından 1997 yılında Uzakdoğu'da yaşanmaya başlanmış olan mali kriz Japonya'ya da etkisi altına almıştır (Bulutoglu, 1997: 10). 1980'lerde ileri teknoloji kullanımı ile birlikte hem araştırma ve geliştirme harcamaları ve hem de teknik personel kullanımı artmıştır (Sadıklar, 1971: 71-78). 1990'lara geldiğinde mali kesimin önderliğinde hizmetler sektörü ağırlıklı bir ekonomik yapıya kavuşmuş olan Japon ekonomisi, dünya üzerindeki en sofistike teknolojiye ve en eğitilmiş nüfusa sahip olmuştur. (Dolanay, 1998: 87; Dolanay ve Uğur, 2018).

Japonya'da 2002 yılında kömür üretimi sona ermiş, bu tarihten sonra ülke kömürde tamamen ithalata bağımlı hale gelmiştir. Enerji elde edilmesinde kömürün kullanılması çevre kirliliğine yol açtığı için doğal gazın Japonya enerji üretimi içindeki payı artmakta, ancak doğal gaz daha pahalı bir enerji kaynağı olduğundan dış ticaret açığının artmasına neden olmaktadır diyebiliriz. Japonya'nın 2013 yılı itibarıyla birincil enerji kaynağı içinde ağırlıklı yeri petrol ve kömür yer almış, birbirine aşağı yukarı eşit düzeyde olmuş olan petrol ve kömür ithalatı miktarının ardından üçüncü sırada doğal gaz ithalatı yer almıştır. 2012 yılı itibarıyla toplam birincil enerji kaynağı tüketimi içinde petrolün payı %47, kömürün payı %27, doğal gazın payı %24, nükleer enerjinin payı %1, diğer yenilenebilir enerji kaynaklarının payı %2 olmuştur. (Şişmanyazıcı, 2018)

Japonya enerji verimliliği konusunda en iyi uygulamalara sahip bir ülkedir ve Japonya dünyada enerji yoğunluğunu asgari düzeylere indirme mücadelesinde en ileri gitmiş ülkedir diyebiliriz. Enerji Tasarrufu Kanunu 1999 yılında yenilenmiş ve yenilenen kanunun en önemli unsurlarından biri Top Runner Programı olmuştur. Japonya'da enerji tasarrufu ve verimliliğine yönelik çalışmalar devlet tarafından desteklenmektedir. Birincil enerji kaynakları açısından büyük oranda dış bağımlılığı bulunan Japonya'da enerji verimliliği devletin öncelikli konuları arasında yer almaktadır. Bu nedenle konuyla ilgili plan ve programlar geniş bir çerçevede ele alınmış ve zamana yayılmıştır. (Dünya'da Enerji Verimliliği (Japonya, ABD ve AB), 2018: 5-7)

Japonya'nın 1973 yılında, birincil enerji arzı bazında petrol, kömür ve doğal gazdan oluşan ithal fosil yakıtı bağımlılığı %94 iken, bu oran 2010 yılında %81'e düşmüş, ancak deprem sonrası oluşan

nükleer santral kazaları nedeniyle mevcut santrallerden kapatılanlar olmuş, 2016 yılında bahsi geçen oran %89'a yükselmiştir. 1973 yılında birincil enerji arzı içinde kömürün payı %16.9, petrol ve diğer fosil yakıt türlerinin payı %75.5, LNG'nin payı %1.6, nükleer gücün payı %0.6, hidro elektrik gücün payı ise %4.4 olmuştur. 2016 yılı itibariyle birincil enerji arzı içinde kömürün payı %25.4, petrol ve diğer fosil yakıt türlerinin payı %39.7, LNG'nin payı %23.8 olmuş, nükleer gücün payı %0.8'de kalmış, hidro elektrik gücün payı %3.3 olmuş, yenilenebilir enerji ve diğer alternatif enerji kaynaklarının payı ise %7 olmuştur. 2010 yılında nükleer gücün payının %11.2 düzeyinde olduğu görülmüştür. (japan_energy, 2017)

2017 yılında Japonya ekonomik olarak büyümüş olmasına karşın, enerji tasarrufu konusundaki çabaları neticesinde toplam birincil enerji tüketimi %0.1 oranında düşmüştür. Enerji verimliliğini artırma çalışmaları neticesinde toplam birincil enerji arzı 2017 yılında %0.1 oranında düşmüştür. (Economic and Energy Outlook of Japan through FY2018, 2017: 1-3)

Japonya'nın 2030 yılı birincil enerji arzı içinde, enerji temininde bugüne göre nükleer güç santrallerinden daha büyük oranda faydalanılmasının düşünüldüğü anlaşılmaktadır. Ayrıca enerji güvenliği ve enerji verimliliğinin artırılması ile birlikte yenilenebilir enerji kaynaklarına daha fazla yönelmenin sağlanması düşünülmektedir. Böylece 2030 yılı itibariyle toplam birincil enerji kaynakları arzı içinde kömürün payının %26, petrolün payının %3, LNG'nin payının %27, yenilenebilir enerji kaynaklarının payının %22-24 ve nükleer gücün payının da %20-22 olması planlanmıştır. (Japan's Energy White Paper 2017, 2017)

Halen Japonya'da 50 adet nükleer enerji reaktörü faaliyet halindedir ve iki yeni reaktörün daha kurulması planlanmıştır. Dünya'da 104 nükleer reaktörle en çok reaktöre sahip ülke ABD'dir. Elektrik enerjisi üretiminde nükleer enerjinin payı açısından Fransa %78 ile ilk sıradadır. Fransa'da 56 reaktör, Rusya'da 33 reaktör, Kanada'da 20 reaktör, İngiltere'de 16 reaktör, Almanya'da 9 reaktör ve Hindistan'da 20 reaktör faaliyet halindedir. (www.internethaber.com, 2018: 3-4)

2011 yılı ekim ayındaki Fukushima kazası sonrası hükümet nükleer gücün enerji teminindeki rolünü azaltma yoluna gitmek istemiştir. Ancak 2012 yılındaki seçimlerde yönetimin değişmesiyle yeni göreve başlayan hükümet, 2014 yılında 20 yıllık öngörüsü olan 4. Stratejik Enerji Planı'nı açıklamıştır. 4. Stratejik enerji planı'nda nükleer enerjinin temel güç kaynağı olduğu açıklanmıştır. Küresel ısınmayla mücadelenin sağlanması, istikrarlı ve güvenilir enerji arzının elde edilmesi için nükleer enerjinin kullanılmaya devam edilmesi gerektiği belirtilmiştir. (World Nuclear Association, 2018: 2)

2011 yılında ülkenin elektrik üretimindeki payı %30 olan nükleer enerjinin payının, 2017 yılında %41'e, 2030'da %50'ye çıkması planlanmıştır. Ardından hükümet 2015 yılında elektrik üretiminde nükleer enerjinin payının 2030 yılında %60'a çıkmasını planladığını açıklamıştır. (World Nuclear Association, 2018: 2)

Dünya genelinde 1960-1973 yılları arası süreç, petrol kaynaklı enerjinin nispeten ucuz olduğu bir dönem olmuştur. Bu dönemde Japonya dahil tüm enerji ithal eden ülkelerin birincil enerji kaynağı olan petrol ithaline bağımlılığı artmıştır diyebiliriz (Dolanay, 1998: 79; Dolanay ve Uğur, 2018: 3-10). Ancak Türkiye'nin ekonomik gelişme sürecinde petrol kaynaklı enerjiye başvurma şansı kalmamıştır.

4.TÜRKİYE

Osmanlı İmparatorluğu döneminde madenler yabancı şirketler tarafından çıkarılmış ve taşkömürü ile madencilik başlamıştır. İlk aydınlatma uygulaması 19. yy sonlarına doğru Şirketi Hayriye'nin İngiltere'den gelen vapurlarıyla başlamıştır. İlk kez 1905'te İzmir ve Selanik'te, ardından da Şam ve Beyrut'ta, 1923 yılında ise Adapazarı'nda elektrikle aydınlatmaya geçilmiştir. (Çavdar, 1983: 690-698; Ültanır, 1994: 41; Dolanay ve Uğur, 2018)

1923 yılında İzmir'de toplanmış olan 1. İktisat Kongresi'nde Ereğli Zonguldak, Soma ve diğer tüm kömür havzalarında iyileştirmeler yapılması ve bütün milli işletmelerin, trenlerin, fabrikaların, tarım makinelerinin yerli kömür kullanmalarının sağlanması hedeflenmiştir. (Mutluer, yty: 186)

Ancak, 1923-1930 arası süreçte elektrik enerjisi yatırımları yabancılara tanınan ayrıcalıklı statülerle gerçekleştirilmiştir (Çavdar, 1983: 690-698).

1923-1930 arası süreçte İş Bankası tarafından taşkömürü işletmeciliği yapılırken, linyit ocakları ise özel sektöre işletilmiştir. 1926 yılında ülke içinde petrol arama hakkı hükümete aitken, petrol ürünleri pazarlaması yabancı şirketlerce yürütülmüştür. Elektrik sektöründe ayrıcalıklı yabancı ortaklıklar faaliyetini sürdürmüştür (Ültanır, 1994: 42). 1930-1939 arasında devletçi-korumacı ekonomik politika yolu ile bir sanayileşme hamlesi başlatılmıştır. (Boratav, 1993: 45-62)

1940-1945 arasındaki yıllarda anlamlı düzeyde yatırım yapılmamıştır. İthalatın ihracattan daha fazla düşmesine paralel olarak dış ticaret fazla vermiştir. 1946-1953 döneminde ithalat serbestleştirilmiş, ithalat artışıyla birlikte dış açıklar vermeye başlanmıştır. Tarım, madencilik, altyapı ve inşaat sektörlerine öncelik veren bir kalkınma stratejisi belirlenmiştir. Dönem boyunca sabit fiyatlarla milli gelir yılda ortalama %11 büyümüştür. (Boratav, 1993: 63-84)

1950 yılında Türkiye elektrik üretim sistemi %96.2 termik, %3.8 birincil kaynak kullanmıştır. Termik kaynaklar içinde ağırlıklı yer tutan taşkömürünün payı %66.48 iken, linyitinki %17.37 ve akaryakıtinki ise sadece %10.33 olmuştur. 1930 yılına göre linyitten daha fazla yararlanılmaya başlanılmakla birlikte, hidrolik gücünden yeterince yararlanılmamış olduğu görülmüştür. 1952 öncesinde büyük kentlere öncelik verilmiştir. (Çavdar, 1983: 690-698)

1960'lı yıllarda nüfusun %30.5'i elektrik enerjisinden yararlanmakta iken, iki büyük enterkonekte sistem ile birkaç bölgesel sistem söz konusu olmuştur. (Çavdar, 1983: 690-698)

1950-1960 arası süreçte özel sektör yatırımlarını ve yabancı sermayeyi çekme çabası içinde

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

olunmuştur. Zira linyit üretiminde özel sektörün payı, 1950'deki %17'lik düzeyinden, 1960'ta %40'a çıkmıştır. (Ültanır, 1994: 43)

1962-1976 arası dönemde Dayanıklı tüketim mallarının yurt içinde montaj sanayilerinin kurularak üretilmesi söz konusu olmuştur. İlerideki yıllarda, bu dönemde kurulan montaj sanayilerinde yerli girdi oranının giderek artmış olduğu görülmüştür. Demir-çelik, bakır, alüminyum, petrokimya, kimya ve inşaat malzemesi gibi ara mallarında ithal ikameci üretim tesisleri de kamu kesiminin katkısıyla kurulmuştur. 1960'larda ihracat içinde sanayi ürünlerinin payı yaklaşık %13-18 iken, 1970'lerde yaklaşık %20-39 olmuştur. 1962-1976 arası dönemde ortalama ekonomik büyüme hızı ise %6.6 olmuştur. (Boratav, 1993: 95-118)

1960-1980 arasında taşkömürü işletmeciliğinde değişiklik olmazken, linyit üretiminin büyük bölümü devlet tarafından gerçekleştirilmiştir. (Ültanır, 1994: 44-45)

1972 yılına gelindiğinde nüfusun %39'u elektriğe kavuşmuştur (Çavdar, 1983: 690-698). Kullanılan birincil kaynaklar arasında akaryakıt ve hidrolik ağırlıklı paya sahip olmuştur (Dolanay, 1998: 113). Petrol ihtiyacının sadece %20'si yurt içinden, diğer kısmı ithal yolu ile sağlanmıştır (DPT İkinci Beş Yıllık Kalkınma Planı, 1968: 558-560).

1980'li yıllarda serbest piyasa ekonomisi içinde ve ihracata dayalı büyüme modeliyle kalkınma sağlanacağı belirtilmiştir (Türel, 1985: 94-103). 1980 sonrasında da kaynak temininde önemli olan tek unsur görece olarak ucuz kaynak bulunabilmesi olmuştur (Altıncı Beş Yıllık Kalkınma Planı, 1990: 257-269). Böylece 1970'li yıllarda oluşan ithal kaynağa bağımlılık süreci devam etmiş görünmektedir. Bununla birlikte petrol yerine, bu kez diğer bir ithal kaynak olan doğal gazla bağımlı bir döneme girilmiş olduğu görülmüştür.

Elektrik enerjisi üretimi 1962'de %42.7 oranında taşkömüründen, %31.6 oranında da su kaynağından sağlanmışken, 1967'de 1962'ye göre taşkömürü ve su kaynağının payı azalmış, akaryakıtın payı artmıştır. 1972 yılında 1967'ye göre, akaryakıtın payı %24.8'den %43.9'a çıkmış su kaynağının payı %38.3'ten %28.5'e düşmüştür. 1977'de 1972'ye göre akaryakıtın payı %33.4'e düşerken, su kaynağının payı %41.8'e, linyitin payı da 1972'deki %13.3'ten, 1977'de %17.5'e çıkmıştır. (Dolanay, 1998: 132; Dolanay ve Uğur, 2018)

Birincil enerji kaynakları üretiminde, 1984-1988 arasında linyitin payı %9.62'den %9'a düşmüş, petrol ürünlerinin payı 1984'teki %41.8'den 1988'de %39.2'ye düşmüş, su kaynağının payı %14.6'dan %25.2'ye çıkmıştır. Birincil kaynaklar içinde petrolün payının düşmesi ve su kaynağının payının artması petrole bağımlılığı azaltıcı olumlu bir gelişme olarak görülmüştür. Linyitin payı 1989'da %33.7'den %40.2'ye yükselmiş, petrol ürünlerinin payı 1994'te %39.1 olmuş, su kaynağının payı 1989'da %20.9'dan 1994'te %23.1'e yükselmiş, odun ile hayvansal ve bitkisel artıkların payı düşmüştür. 1990 yılı itibariyle hidroelektrik potansiyelinin sadece %37'sine ulaşılabilmektedir. Toplam birincil enerji

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

kaynağı tüketimi içinde petrol ürünlerinin payı 1984'teki %41.8'lik düzeyinden 1988'de 40.4'e gerilemiş, doğal gazın payı %0.1'den %2.2'ye çıkmış, su kaynağının payı da %8.6'dan %14.7'ye yükselmiştir. Linyit ve taşkömürü kullanımında dönem boyunca önemli bir değişiklik olmamıştır. Dolayısıyla petrol ve petrol ürünleri kullanımından su kaynağı ve doğal gaz kullanımına doğru bir yöneliş oluşmuştur. (Dolanay, 1998: 134-136; Dolanay ve Uğur, 2018)

Toplam birincil enerji kaynağı tüketimi içinde petrol ürünlerinin payı 1989-1994 arasında da düşme eğilimini sürdürmüştür, 1989'da %40 olan oran 1994'te ufak bir azalışla %39.8'e gerilemiştir. Doğalgazın toplam içindeki payı 1988'de %2.2 iken, 1989'da %5.2'ye ve 1994'te de %8.3'e yükselmiştir. Su kaynağının payı ise 1989-1994 döneminde fazlaca değişmezken, linyit ve taşkömürü kullanımında ufak çaplı düşüşler gözlenmiştir. Taşkömürü tüketimi 1978-1983 arasında %2.6 artmış, 1989-1994 arasında ise %12.7 oranında artış göstermiştir (Dolanay, 1998: 133). 1984-1988 arası dönemde petrol ürünü tüketimi nispi olarak düşer ve doğalgaz ile su kaynağının kullanımı artarken, 1989 sonrasında çoğunlukla ithal doğalgaz kullanımına yönelme olmuştur (Dolanay, 1998: 137). Petrol tüketimi 1978-1983 döneminde binde 3 düşmüş, 1984-1989 ve 1989-1994 dönemlerinde sırasıyla %5.1 ve %7.8 artmıştır. Bu görece bir düşüştür. Doğalgaz tüketimi 1978-1983 döneminde azalmışken, 1984-1989 arasında %138.1 gibi yüksek bir oranda, 1989-1994 arasında ise %18.8 oranında artmıştır (Dolanay, 1998: 133). Böylece ithal petrole bağımlılık azaltılırken, başka bir ithal kaynak olan doğalgaza bağımlılık oluşturulmuştur. Oysa kaynak kullanım yapısı içinde kaynak çeşitliliğine mümkün olduğunca gidilmeli, hidrolik enerjiden daha çok yararlanılabilmeli ve nükleer enerjide kullanılan kaynaklar arasına girebilmelidir (Dolanay, 1998: 137). Elektrik enerjisi ithali 1978-1983 yılları arasında %28.9 artmış, ithal elektrik enerjisi tüketimi 1984-1989 arasında %33.3 düşmüştür (Dolanay, 1998: 133; Dolanay ve Uğur, 2018).

1989 yılında toplam üretim içinde termik enerjinin payı %58 iken, hidrolik enerjinin payı %42 olmuş, toplam tüketim içinde termik enerjinin payı %65.5 ve hidrolik enerjinin payı ise %34.5 olarak gerçekleşmiştir. Altıncı plan döneminde hidrolik enerjinin üretim içindeki payı %47 olurken, tüketim içindeki payı %39 olmuştur. (Altıncı Beş Yıllık Kalkınma Planı, 1990: 257-269)

1994 yılında toplam üretim içinde termik enerjinin payı %56 olurken, hidrolik enerjinin payı %46 olmuştur. Toplam tüketim içinde termik enerjinin payı %68'e yükselirken, hidrolik enerjinin payı %32'de kalmıştır. Dolayısıyla toplam tüketim hidrolik tüketiminden hızlı artmıştır diyebiliriz. 1994-1995 yıllarında enerji ihracatı yapılabilmektedir. İhracat ise enerji üretimindeki artıştan ziyade ekonomik durgunluk ve hatta gerilemeden kaynaklanmış görünmektedir. (Altıncı Beş Yıllık Kalkınma Planı, 1990: 257-269)

Hidrolik enerji üretiminin 1995-2000 arasında %13, 2000-2001 arasında ise %22 oranında azalmış olduğu, 2001-2006 arasında ise %84 oranında artmış olduğu görülmüştür. Toplam enerji

tüketimi içinde hidrolik enerjinin payı 2000 yılında %38 iken, 2006 yılında %44.4³³ olmuştur. (2005-2006 Türkiye Enerji Raporu,2007: 6)

Bu yükselişe karşın, petrol ve doğalgazın birlikte kullanımı 2006 yılında %62.96'ya çıkmıştır. Petrol ve doğalgaz gibi iki fosil yakıtta bu bağımlılık tablosu ise nükleer santral kurulması gerekliliğini ortaya çıkarmıştır. (Dolanay ve Uğur, 2018: 12-18)

2003 yılında birincil enerji kaynakları tüketimin %38'i petrol, %27'si kömür, %23'ü doğalgaz ve kalan yaklaşık %12'lik bölüm ise hidrolik enerji kaynakları ile elde edilmiştir. 2005 yılında enerji ihtiyacının %72'sinin ithalat yoluyla karşılandığı görülmüştür. (Külebi, 2007: 30-31)

Kendimize yetecek derecede enerji kaynağımızın bulunmaması, ithalatı zorunlu kılsa da akılcı yaklaşımla ithalatın mümkün olduğunca çok ülkeden karşılanması gerektiği düşünülmüştür (Külebi, 2007: 31-33). Örneğin doğalgaz tüketiminin toplam enerji tüketimi içinde yaklaşık %30'a ulaşması da tek veya petrolle birlikte iki kaynağa bağımlılığı oluşturabilecektir (Külebi, 2007: 31-33). Zira 2006 yılı itibariyle genel enerji tüketiminin birincil enerji kaynaklarına dağılımından taşkömürü %23, doğalgaz %31.44 oranında pay almaktadır (2005-2006 Türkiye Enerji Raporu, 2007: 6). Dolayısıyla geçmişe göre 2006 yılında ithal doğalgaza bağımlılık artmıştır diyebiliriz (Dolanay ve Uğur, 2018: 12-18).

1990 yılında nihai enerji tüketimi içinde doğalgazın payı %1.9'dan, 2006 yılında %17.4'e yükselmiştir. Bu dönemde jeotermal ısı kullanımında ve güneş enerjisi tüketiminde artış gözlenirken, 1999 yılından itibaren rüzgardan elektrik enerjisi üretimine başlanılmıştır. 2006 yılında nihai enerji tüketiminde petrol %35.6 ile en yüksek paya sahip olmuştur. 2006 yılında petrol ve doğalgaz gibi fosil yakıtlara bağımlılık devam etmiştir. 2006 yılında petrol, doğalgaz, taşkömürü ve elektrik enerjisi ithal edilmiştir. (2005-2006 Türkiye Enerji Raporu, 2007: 8-9)

1990 yılından 2006 yılına gelinceye kadar nihai enerji tüketimi içinde petrolün payı %36'dan, sadece %35.6'ya düşebilmiştir. (2005-2006 Türkiye Enerji Raporu, 2007: 8)

2012 yılında Türkiye birincil enerji kullanımının yani talebinin %30'u kömür, %28'i petrol, %32'si doğal gaz ve kalan %10'luk kısmı ise yenilenebilir enerji kaynaklarından karşılanmıştır. (BOTAŞ 2014 Yılı Sektör Raporu, 2015: 13)

2014 yılı itibariyle, Türkiye elektrik enerjisi üretiminin enerji kaynakları oranı termik (kömür, petrol ve doğal gaz) enerji %79.5, hidrolik enerji %16.1 ve yenilenebilir enerji (rüzgar, güneş ve jeotermal) %4.3 olmuştur. Yenilenebilir enerji kaynaklarının payı 2002 yılındaki %0.1'den, 2014 yılında %4.3'e, 2015 yılında %5.8'e çıkmıştır. 2015 yılı itibariyle, elektrik enerjisi üretiminin enerji kaynakları oranı termik enerji %68.5, hidrolik enerji %25.7 ve yenilenebilir enerji kaynakları %5.8

³³Dünya Enerji Konseyi Türk Milli Komitesi, 2005-2006 Türkiye Enerji Raporu, s. 6'da bulunan tablo 2'de 2006 hidrolik enerji rakamına jeotermal elek. rakamı eklenerek elde edilen rakamdan bu yıl için jeotermal elek. rakamı 100 kabul edilerek hidrolik enerji rakamına ulaşılmıştır.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

olmuştur. (Dünya ve Ülkemiz Enerji ve Tabii Kaynaklar Görünümü, 2016, 17)

2015 yılında Türkiye birincil enerji arzı içinde petrolün payı %30.3, doğal gazın payı %30.7, taş kömürünün payı %17.4, linyitin payı %9.4, hidrolik enerjinin payı %4.5, Jeotermal ısı ve diğer ısı kaynaklarının payı %3.7, rüzgar enerjisinin payı %0.8, güneş enerjisinin payı %0.6 ve elektrik enerjisinin payı ise %0.3 olmuştur (Türkiye Enerji Görünümü, 2017: 10). Türkiye'nin 2015 yılında birincil enerji kullanımı içinde petrolün payı %30, doğal gazın payı %31, kömürün payı %27, hidrolik enerjinin payı %4.5 ve diğer yenilenebilir kaynakların payı ise %7.5 olmuştur (2016 Yılı Ham Petrol ve Doğal Gaz Sektör Raporu, 2017, 30).

2016 yılında Türkiye toplam birincil enerji tüketimi içinde kömür, petrol ve doğal gazın toplamının payı %87.3 olmuştur. 2000-2016 yılları arası süreçte kömür ve petrol tüketimi artmış olsa da, bu kaynakların toplam birincil enerji tüketimi içindeki payları azalmıştır. Kömür 2000 yılında %28.6 oranında paya sahip olmuşken, 2016 yılındaki payı %28.2 olmuştur. Petrol'ün 2000 yılındaki %42.3 oranındaki payı ise 2016 yılında %31 seviyesine düşmüştür. Doğal gazın 2000 yılındaki %15.7 oranındaki payı, 2016 yılında %28.1 oranına yükselmiştir. Güneş, rüzgar, jeotermal ısı ve biyoyakıt tan oluşan yenilenebilir enerji kaynaklarının payı 2000-2016 yılları arası süreçte yıllık ortalama %14.4 artış göstermiştir. (2000-2016 Türkiye Enerji Verimliliği Gelişim Raporu, 2018, 12)

2016 yılında Türkiye'nin birincil enerji yoğunluğu, 2000 yılına göre %19.6 oranında azalmış ve böylece enerji verimliliği artmıştır. (2000-2016 Türkiye Enerji Verimliliği Gelişim Raporu, 2018, 18)

Üretimin talebi karşılamadığı enerji türleri ithal edilerek tüketiciye sunulmaktadır. Türkiye enerji talebinin %60'ının dış kaynak kullanımı yoluyla karşılandığı söylenebilecektir. Dış kaynaklar içinde en büyük paya petrol sahiptir. Ancak doğalgazın payı da artmaktadır. (Külebi, 2007: 34)

2002 yılında elektrik üretiminde doğalgaz kullanım payı %26, kömürün payı %35 olarak gerçekleşmiş, 2006 yılında ise doğalgazın payı %44'e çıkarken, kömürün payı %20'ye inmiştir (Külebi, 2007: 40). 2006 yılı itibariyle yerli kaynak kullanımının yeterince özendirilemediği görülmüştür (Dolanay ve Uğur, 2018: 12-18).

2006 yılı itibariyle kişi başına GSMH 5477 ABD Doları, işsizlik oranı %9.9, GSYH artış hızı %6.9, GSMH büyüme hızı %6 olarak gerçekleşmiştir. 2007 yılına gelindiğinde GSYH artış hızı %4.7 olmuş, GSMH büyüme hızı %4.5 olmuştur. Bu ekonomik yapısı ile Türkiye gelişmekte olan bir ülke konumunda görünmüştür. (<http://www.ktu.edu.tr>; www.tuik.gov.tr; www.kalkinma.gov.tr)

2016 yılı itibariyle kişi başına GSYH 12670 ABD Doları, işsizlik oranı %8.9, GSYH artış hızı %5 olarak gerçekleşmiştir. Türkiye 2009 yılında yaşanmış olan küresel ekonomik krizden görece olarak en hızlı şekilde çıkabilen, 2003-2008 yılları arasındaki yıllık yüksek ekonomik büyüme hızları ile gerçekleştirmiş olduğu ekonomik gelişmesini 2009 yılı sonrasında da gerçekleştirebilme yoluna

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

girmiştir diyebiliriz. Kişi başına GSYH 2002-2013 yılları arası süreçte 3 kattan fazla artmış ve 3492 ABD Doları'ndan, 10782 ABD Doları'na yükselmiştir. (<http://www.ktu.edu.tr>)

1973-1974 petrol krizi; Türkiye'de ithal enerjiye bağımlılığın azaltılamaması ve hatta bu ihtiyacın hiçbir şekilde gündeme gelmemesi nedeniyle ülke ekonomisini derinden etkilemiştir. Bu tarihten sonra ise enerji tasarrufu yapmanın ve alternatif enerji kaynaklarına yönelmenin gerekliliği vurgulanmıştır. Ancak bu dönemde alternatif enerjilerin yeterince kullanımı ve nükleer enerjiye geçiş sağlanamamıştır. (Dördüncü Beş Yıllık Kalkınma Planı, 1979: 394-408)

İkinci petrol krizi yıllarında ise enerji yatırımlarına öncelik verilmesine karşın, enerji tüketiminde ithal bağımlılığı azaltılamamıştır. İlk kriz nedeniyle yüksek dış borç kullanımı 1977 bunalımının şiddetini belirlemiş ve ülke ekonomisi üzerinde krizlerin etkileri daha büyük olmuştur (Dolanay, 1998: 115). Ekonomik krizin derinleşmesi ülke ekonomisinde kapsamlı ekonomik politika değişikliklerini bir anlamda zorunlu hale getirmiştir. 24 Ocak 1980 ekonomik istikrar programı söz konusu olmuştur. Her ne kadar artan enerji ihtiyacını karşılamak için ithalat önemli olmaya devam etmiş olsa da, özel sektörü enerji yatırımlarına çekebilmek amacıyla çeşitli tedbirlere başvurulmuştur (Ültanır, 1994: 45-46).

Birim çıktı başına kullanılan enerji yani enerji yoğunluğu rakamı gelişmekte olan ülkelerde, gelişmiş ülkelere göre daha yüksek gerçekleşmekte, sanayileşme ve ekonomik gelişme hızı arttıkça enerji yoğunluğu da yükselmektedir (Saarçioğlu ve Küçükaksoy, yty: 6). Gelişmekte olan bir ülke olarak Türkiye, sanayileşme sürecinde artan miktarda enerji kullanmak zorunda kalmış, bu artan ihtiyacı petrolden karşılaması güç olduğu için alternatif enerji kaynağına başvuramadığı için de aklardan tüm ihtiyacın karşılanması için alternatif enerji kaynaklarına yönelme gereği ortaya çıkmıştır diyebiliriz.

2002-2016 yılları arası süreçte sağlanmış olan yüksek ekonomik büyüme hızlarının getirmiş olduğu hızlı ekonomik gelişme, enerji sektöründeki gelişmelerde de yansımaları bulmuştur diyebiliriz. 2002-2016 yılları arası süreçte birincil enerji arzı, birincil enerji kullanımı ve elektrik enerjisi üretimi içinde yenilenebilir enerji kaynaklarının payı artmıştır. Enerji verimliliğinde artış gerçekleşmiştir. (Dolanay ve Uğur, 2018: 17-19)

Nükleer santrallerin yatırım bedeli kömür ve fuel oil santrallerine göre daha fazla olmasına karşın, yıllık yakıt masrafları düşük olduğu için elektrik üretim maliyeti daha düşük olabilmektedir (Tuncer, 2003: 81-97). Nükleer santrallerin en önemli özelliklerinden biri sabit maliyetlerinin yüksek, değişken maliyetlerinin ise daha düşük seviyelerde olmasıdır. Bu nedenle diğer santral türleri ile karşılaştırıldığında birim kurulu güç başına, faiz ve finansman giderleri hariç inşa maliyeti açısından nükleer santraller lider konumundadır. Bir güç santralinin kullanım ömrü boyunca üretilen toplam enerji miktarı ne kadar fazla ise o santralin aynı oranda etkin kullanılabildiği söylenebilir. Dolayısıyla kısa sürede devreye alınabilen ve nükleer santrallere göre daha düşük maliyetli olan kömür ve gaz santralleri,

uzun vadede yakıt maliyetleri daha yüksek olan santral türleridir. Bu tür santraller eşit miktarda elektrik üretmeleri durumunda yakıt maliyetleri nükleer santrallere göre çok daha pahalı olacaktır (Demirbağ, 2013: 72-73).

Türkiye'nin iki ayrı yerinde nükleer güç santrali kurulması planlanmış ve Mersin/Akkuyu nükleer güç santralının inşasına başlanmıştır. Her ne kadar nükleer güç santrallerinin çevre kirliliğine yol açtığı ve bu nedenle kurulmasının doğru olmadığı söylenmiş olsa da, dünya genelindeki uygulamalar aksini göstermiştir. Finlandiya'da nükleer güç santralının hemen yanında balık avlanabildiği görülmüş, Loire Nehri üzerinde 5 adet nükleer güç santrali kurulabilmiş, Paris'e 200 km mesafede 6 adet nükleer güç santralının bulunduğu anlaşılmıştır. Aynı şekilde, İngiltere'deki 16 nükleer güç santralinden 6 tanesinin Londra'ya 75 ila 200 km mesafede olduğu görülmüştür. Yine Belçika'da Doel nükleer güç santralının hemen yakınında tarımsal faaliyetler sürdürülebilmektedir. (Saraçoğlu, 2018: 45-47)

Toryum madeni tıpkı uranyum gibi nükleer santrallerden enerji elde edilmesinde kullanılabilir. Üstelik verimi uranyuma göre daha yüksektir ve nükleer santral patlamalarını zorlaştırmaktadır. Toryum madeni açısından Türkiye 380.000 ton ile dünya da sayılı en büyük rezerve sahiptir. (Adalıoğlu vd., 2001)

Aynı miktarda enerji elde etmek için kullanılması gereken kaynak miktarı toryum için bir ton, uranyum için 200 ton, petrol için 1.000.000 ton, kömür için ise 3.500.000 ton dur. (Toryum madeni hakkında bilinmeyenler ve Toryum Gerçeği, 2017)

Ayrıca Türkiye halen kullandığı doğal gazın %98'ini ithal etmektedir. Enerji ithali için her yıl yaklaşık 50 milyar ABD Doları harcanmaktadır. Akkuyu ve Sinop nükleer güç santralleri devreye girdiğinde yıllık 7.2 milyar ABD Doları tutarındaki doğal gaz satın alınmamış olacaktır diyebiliriz. (Saraçoğlu, 2018: 45-47)

5. SONUÇ ve TÜRKİYE'NİN GELECEK ENERJİ POLİTİKASI TERCİHLERİNE İLİŞKİN ÖNERİLER

Dünyada geçmişte yaşanan tecrübelerden sonra petrol yerine alternatif enerji kaynaklarının kullanımı konusunda mesafe kaydedildiği anlaşılmaktadır. Türkiye'de ise son dönemde kurulan doğal gaz santralleri yolu ile, petrolden doğal gaza yönelim sağlanmış olsa da, petrol ve doğal gaz gibi iki kaynağa bağımlılık sürmüştür diyebiliriz. 2002-2016 yılları arası süreçte yenilenebilir enerji kaynaklarından daha fazla yararlanılma yoluna gidilebilmiş, ancak tüm enerji ihtiyacının yenilenebilir enerji kaynaklarından karşılanabilmesinden oldukça uzak kalınmıştır. Dolayısıyla hem kaynak çeşitlenmesine gidebilmek, hem de petrol, kömür ve doğal gaza göre daha ucuz bir kaynak temin yöntemi olan nükleer güç santrallerinden enerji temininde yararlanma yoluna girilerek, ilk etapta iki ve ardından üçüncü olmak üzere nükleer güç santralleri kurulması planlanmıştır. Nükleer güç santrallerinden enerji temininde yararlanılması projesi, Türkiye'nin nükleer güç santrallerinde

kullanılabilecek ikinci bir yakıt türü olan toryum madeni açısından dünya sıralamasına girecek ölçüde zengin bir ülke olması nedeniyle de önem arz etmektedir diyebiliriz. Bundan sonraki süreçte nükleer enerji yanında yenilenebilir enerji kaynaklarından da daha fazla yararlanılabilmelidir.

KAYNAKLAR

- Adalıoğlu U., Bayülken A., Dayday N., Gençay Ş., Özemre A. Y. ve Türkcan E. (2001), “Yakın Geleceğin Nükleer Yakıtı Olarak Toryum”, İstanbul, <https://www.ozemre.com/default/files>, Erişim Tarihi: 09.07.2018,
- Amsden A. H. (1989), “Asia's Next Giant South Korea and Late Industrialization”, Oxford University Press, New York-Oxford.
- Ausubel J. H. (2000), “Where is Energy Going?”, Program for the Human Environment, Rockefeller University, <https://phe.rockefeller.edu/where>.
- Bahar O. (2005), “Türkiye’de Enerji Sektörü Üzerine Bir Değerlendirme”, Muğla Üniversitesi SBE Dergisi, Bahar 2005, Sayı 14, Muğla, <http://www.dergipark.gov.tr>, Erişim Tarihi: 18.11.2018,
- Boratav K. (1993), “Türkiye İktisat Tarihi 1908-1985”, Gerçek Yayınevi, Yeni Dizi, 4. Baskı, Ankara, Çavdar Tevfik (1983), Cumhuriyet Dönemi Türkiye Ansiklopedisi, c. 3, İletişim Yayınları, Ankara, Ekim 1983.
- BOTAŞ (Boru Hatları ile Petrol Taşıma A.Ş.) (2015), 2014 Yılı Sektör Raporu, 13; [www.enerji.gov.tr/File/2014 Yılı Sekt...](http://www.enerji.gov.tr/File/2014%20Yılı%20Sekt%20Raporu), Erişim Tarihi: 24.06.2018.
- Bulutoğlu K. (1997), “Asya gribi Batı’ya bulaşacak mı?”, Yeni Yüzyıl, 16 Aralık 1997, s. 10
- Demirbağ A. İ. (2013), “Yerel Bir Kaynağımız Olarak Toryum Madeninin Nükleer Enerji Üretiminde Kullanılabilirliğinin İncelenmesi”, İstanbul Teknik Üniversitesi Enerji Enstitüsü, Enerji, Bilim ve Teknoloji Ana Bilim Dalı, Enerji, Bilim ve Teknoloji Programı, Yüksek Lisans Tezi, Haziran 2013, İstanbul, 72-73, <https://polen.itu.edu.tr/YuksekLisansTez>, Erişim Tarihi: 17.07.2018,
- Dolanay S. S. (1998), “Türkiye’de Enerji Sanayileşme İlişkileri”, Yüksek Lisans Tezi, Ankara.
- Dolanay S. S., Uğur L. O. (2009), Enerji Politikasının Bir Unsuru Olarak Enerji Kaynaklarının Kullanımı (Türkiye – G. Kore karşılaştırması), Dünya Enerji Konseyi Türk Milli Komitesi, 11. Enerji Kongresi, İzmir.
- Dolanay S. S. (2017), “Otomotiv Sektöründe Teknoloji Transferi ve Teknoloji Geliştirme Yeteneğinin Kazanılması: Güney Kore ve Türkiye Örneği”, Doktora Tezi, Isparta.
- Dolanay S. S., Uğur L. O. (2018), Enerji Politikasının Bir Unsuru Olarak Enerji Kaynaklarının

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Kullanımı (Türkiye – Japonya karşılaştırması), ICEESS (International Conference on Empirical Economics and Social Sciences) 2018, Bandırma,

Dünya Enerji Konseyi Türk Milli Komitesi (2007), 2005-2006 Türkiye Enerji Raporu, Ankara, <https://www.yumpu.com>view>2005-...>, Erişim Tarihi: 13.06.2018,

International Energy Agency (1997) Statistics, Energy Balances of OECD Countries, 1994-1995, Paris, 130-133.

Dünya'da Enerji Verimliliği (Japonya, ABD ve AB), 07.06.2018, s. 5-7, <https://www.enerjigazetesi.ist/kose-yazisi-dunyada-enerji-verimliliği-japonya-abd-ve-ab/amp/>, Erişim Tarihi: 12.06.2018.

Economic and Energy Outlook of Japan through FY2018, The Institute of Energy Economics, Japan, The 426th Forum on Research Work, IEEJ July 2017, 25 July 2017, 1-3, <https://eneken.ieej.or.jp>press170725>, Erişim Tarihi: 25.06.2018,

Ekonomik Büyüme, http://www.ktu.edu.tr/dosyalar/bmyo_c1638.pdf, Erişim Tarihi: 13.07.2018,

japan_energy_2017, 4, <http://www.enecho.meti.go.jp/>

Eski H. (1989), "İhracata Yönelik Sanayileşme Stratejisi ve Güney Kore Deneyi", Bilgehan Basımevi, Bornova-İzmir.

Horika C. Y. (1994), "Japan's consumption and saving in international perspective", Economic Development and Cultural Change, Vol. 42, Iss. 2, January 1994, s. 293-316, <https://www.journals.uchicago.edu>abs>, Erişim Tarihi: 28.11.1997.

Japan's Energy White Paper 2017, Japan's Energy Landscape and Key Policy Measures, Ministry of Economy Trade and Industry, 2017, Japan, 4; <http://www.meti.go.jp>report>downloadfiles>, Erişim Tarihi: 08.07.2018,

KEEI (Korea Energy Economics Institute) (2016), Energy Info. Korea, ISSN 2233-4386, www.keei.re.kr, Erişim Tarihi: 24.10.2018.

Köksal B. ve Civan A.(2009), "Factors that Affect the Decision of Having Nuclear Energy and Predictions for Turkey", MPRA (munich Personal RePEc Archive), MPRA Paper No. 30513, posted 7 October 2013 13: 23 UTC, Munich, <http://mpra.ub.uni-muenchen.de/30513/>, Erişim Tarihi: 21.10.2018.

Köseoğlu Z. (1997), Uluslar arası Enerji Üretim ve Ticaretinde Türkiye'nin Konumu ve Rolü Paneli, Dünya Enerji Konseyi Türk Milonferans Kli Komitesi, Türkiye 7. Enerji Kongresi, Ankara, 3-8 Kasım 1997.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

KUIE (Kore Ulusal İstatistik Enstitüsü), Seul Büyükelçiliği Ticaret Müşavirliği, Güney Kore, 2008.

Kuruç B., Akyüz Y., Artun T., Türel O., Ketenci Ş., Karakaş E., Türkcan E., Berksoy T., Törüner M., Boratav K., (1985) ‘‘Bırakınız Yapsınlar Bırakınız Geçsinler Türkiye Ekonomisi 1980-1985’’, Bilgi Yayınevi, İkinci basım, Ankara, Ekim 1985 içinde,

Külebi A. (2007), ‘‘Türkiye'nin Enerji Sorunları ve Nükleer Gereklilik’’, Bilgi Yayınevi, Birinci Basım, Ankara.

Leipzig D. M. (1988), ‘‘Industrial Restructuring in Korea’’, Danny M. Leipziger Korea Transition to Maturity, Pergamon Press Inc. içinde,

Mutluer M. (yty), ‘‘Gelişimi, Yapısı ve Sorunlarıyla Türkiye’de Enerji Sektörü’’, <http://www.dergipark.gov.tr/download/article-file>, Erişim Tarihi: 18.11.2018,

Saatçioğlu C. ve Küçükaksoy İ. (yty), ‘‘Türkiye Ekonomisinin Enerji Yoğunluğu ve Önemli Enerji Taşıma Projelerinin Ekonomiye Etkisi’’, <https://birimler.dpu.edu.tr/app/views/panel/ckfinder/userfiles/17/files/.../19-41.pdf>, Erişim Tarihi: 08.12.2018

Sadıklar C. T. (1971), ‘‘Zirvedeki Japonya’’.

Saraçoğlu C. (2018), ‘‘Enerji Esaretinden Kurtulmanın Kısa Yolu Nükleer Güç’’, Derin Ekonomi, Sayı: 36, Mayıs 2018, İstanbul, 2018, 45-47; www.derinekonomi.com.

Şişmanyazıcı H.: Japonya'nın Enerji Politikası, Deniz Haber Ajansı, Erişim Tarihi: 07.06.2018, <http://www.denizhaber.com.tr/yazi/japonyanın-enerji-politikasi-361.htm>, Erişim Tarihi: 23.06.2018,

T.C. Başbakanlık Devlet Planlama Teşkilatı, Altıncı Beş Yıllık Kalkınma Planı, Ankara, 1990, 257-269, <http://www.kalkinma.gov.tr/Lists/plan6>, Erişim Tarihi: 11.06.2018,

T.C. Başbakanlık Devlet Planlama Teşkilatı, Dördüncü Beş Yıllık Kalkınma Planı, Ankara, 1979, 394-408, <http://www.kalkinma.gov.tr/Lists/plan4>, Erişim Tarihi: 15.06.2018,

T.C. Başbakanlık Devlet Planlama Teşkilatı, İkinci Beş Yıllık Kalkınma Planı, Ankara, 1968, 558-560, <http://www.kalkinma.gov.tr/Lists/plan2>, Erişim Tarihi: 11.06.2018,

T.C. Enerji ve Tabii Kaynaklar Bakanlığı Yenilenebilir Enerji Genel Müdürlüğü (2018), 2000-2016 Türkiye Enerji Verimliliği Gelişim Raporu 2018, Enerji Verimliliği Daire Başkanlığı, Ölçme ve Değerlendirme Grubu, EV-2018-01-V1, Ankara,12; www.yegm.gov.tr, Erişim Tarihi: 25.06.2018,

T.C. Enerji ve Tabii Kaynaklar Bakanlığı Strateji Geliştirme Başkanlığı (2016), Dünya ve Ülkemiz

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Enerji ve Tabii Kaynaklar Görünümü, Sayı 14, 01 Ekim 2016, 17; [www.elder.org.tr/enerji bakanlığı](http://www.elder.org.tr/enerji-bakanligi) yayın, Erişim Tarihi: 23.06.2018,

T.C. Resmi Gazete, 4 Aralık 1984, Kanun No: 3096, Sayı: 18610.

The World Bank (1997), World Development Report 1997, Oxford University Press, first printing, June 1997, s. 214-237,

The World Bank (1996), World Development Report 1996, Oxford University Press, first printing, June 1996, s. 188-222,

The World Bank (1995), World Development Report 1995, World Development Indicators, Oxford University Press, first printing, June 1995, s. 162-225.

TMMOB Makina Mühendisleri Odası Enerji Çalışma Grubu(2017), Türkiye Enerji Görünümü, Ankara, Eylül 2017, <https://www.mmo.org.tr/merkez/haber>, Erişim Tarihi: 24.06.2018, 10.

Toryum madeni hakkında bilinmeyenler ve Toryum Gerçeği, Medya Güneş Haberin Doğru Adresi, 26 Ekim 2017, www.youtube.com, Erişim Tarihi: 09.07.2018,

Tsuru S. (1993), "Japan's Creative Defeat and Beyond", Cambridge University Press, Great Britain.

Tuncer G., Eskibalçı M. F. (2003), "Türkiye'de Enerji Hammaddeleri Potansiyelinin Değerlendirilebilirliği", İstanbul Üniversitesi Mühendislik Fakültesi Yer Bilimleri Dergisi, C. 16, S. 1, İstanbul, 87, 81-92, <http://www.dergipark.gov.tr/download/article-file>, <http://www.journals.istanbul.edu.tr/view>, Erişim Tarihi: 17.07.2018,

Türel O. (1985), "1980 Sonrasında Kamu Kesimi ve Finansmanı Üzerine Gözlem ve Değerlendirmeler", Türkiye Petrolleri (2017), 2016 Yılı Ham Petrol ve Doğal Gaz Sektör Raporu, Mayıs 2017, 30; www.tpao.gov.tr/sectorrapor_2806, Erişim Tarihi: 25.06.2018.

Türkiye'yi En Güçlü Yapacak Olan Toryum Madenleri! Ne Zaman İşlenecek? Yeni Element, Derin Tarih, www.youtube.com, Erişim Tarihi: 10.07.2018,

Ültanır M. Ö. (1994), Ulusal Enerji Politikasına Eklenmesi Gereken Yeni Boyutlar, Dünya Enerji Konferansı Türk Milli Komitesi, Türkiye 6. Enerji Kongresi Teknik Oturum Tebliğleri – 4, İzmir, 17 – 22 Ekim 1994,

World Nuclear Association, Nuclear Power in South Korea, <http://www.world-nuclear.org/information-library/country-profiles/countries-o-s/south-korea.aspx>, Erişim Tarihi: 31,19,3018.

www.internethaber.com/dunyadaki-nukleer-santraller-hangi-ulkenin-kaç-santrali-var-liste-bomba-1860467h.htm, Erişim Tarihi: 31.10.2018.

www.tuik.gov.tr, Erişim Tarihi: 05.06.2018

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

www.kalkinma.gov.tr, Erişim Tarihi: 05.06.2018

Yager J. A. (1984), "The Energy Balance in Northeast Asia", The Brookings Institution, Washington D.C.

World Nuclear Association, Nuclear Power in Japan, <http://www.world-nuclear.org/information-library/country-profiles/countries-g-n/japan-nuclear-power.aspx>

World Nuclear Association, Nuclear Power in South Korea, <http://www.world-nuclear.org/information-library/country-profiles/countries-o-s/south-korea.aspx>



**VADELİ PİYASALARDA KORUNMA ORANI VE ETKİNLİĞİNİN BELİRLENMESİ :
BORSA İSTANBUL UYGULAMASI**

Doç.Dr Yasemin Deniz KOÇ*

Doç.Dr Sibel ÇELİK**

Dr. Öğr. Üyesi Ferit KARAHAN***

ÖZET

Bu çalışmada spot BIST-30 endeksi ve vadeli BIST-30 endeksi verileri kullanılarak vadeli piyasalarda korunma oranı ve korunma oranı etkinliği OLS ve VECM modelleri ile test edilmiştir. Sonuçta, vadeli ve spot piyasaların entegre yani eşbütünleşik olduğu, OLS korunma oranı ile korunan portföyün getirisinin VECM korunma oranı ile korunan portföy getirisinden yüksek olduğu; OLS korunma oranı ile korunan portföy varyansının ise VECM korunma oranı ile korunan portföy varyansından düşük olduğu görülmüştür. Bulgular OLS korunma oranının VECM korunma oranından daha yüksek performans gösterdiğini destekler niteliktedir.

Anahtar Kelimeler: *Korunma Oranı, Vadeli Piyasa, Eşbütünleşme Testi.*

1.GİRİŞ

Menkul kıymet piyasaları genel hatlarıyla belirli riskleri içeren alanlardır. Döviz kurlarında ve faiz oranlarında yaşanabilecek değişimler, belirsizlik ortamları, ekonomik ve konjunktürel hareketli dönemler bu piyasalarda var olan riski arttıracak faktörler arasında sayılabilir. Herhangi bir risk faktörü ile karşı karşıya kalan bir yatırımcının çeşitli yatırım araçları aracılığıyla var olan riski elimine etme çabası genel olarak hedging yani korunma kavramı ile açıklanabilmektedir.

Riskli yatırım araçlarından korunmanın sağlanabilmesi amacıyla türev yatırım araçları ülkemizde de Borsa İstanbul bünyesinde vadeli işlemler ve opsiyon borsasında işlem görmektedir. Önceki ismi ile ilk olarak İzmir vadeli işlem ve opsiyon borsası olan bu piyasa 2 ağustos 2013 tarihi itibarıyla borsa İstanbul bünyesinde işlemlerini gerçekleştirmektedir.

Türev yatırım araçları vasıtasıyla vadeli piyasalarda işlem yapan kişi ve ekonomik birimler portföy riskini kontrol etmek ve minimize etmek amacıyla optimal hedge (korunma) oranını belirlemek zorundadırlar. (Evcı, Kandir;2017) Hedge oranı bir birimlik riskli pozisyona karşılık vadeli piyasada ne kadarlık bir korunma pozisyonu alınması gerektiğini ifade eder. En iyi korunma pozisyonu ile olumsuz gelişmeleri tamamen elimine edip olumlu gelişmelerden eksiksiz bir şekilde yararlanma sağlayan korunma pozisyonu iki ayırık noktayı temsil etmektedir. Bu iki durum arasında farklı korunma

* Dumlupınar Üniversitesi, Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Bankacılık ve Finans, Kütahya/ Türkiye

** Dumlupınar Üniversitesi, Uygulamalı Bilimler Yüksekokulu, Sigortacılık ve Risk Yönetimi, Kütahya/ Türkiye

*** Dumlupınar Üniversitesi, İktisadi İdari Bilimler Fakültesi, Uluslararası Ticaret ve Finans, Kütahya/ Türkiye

pozisyonları oluşturulabilir. Bir yatırımcı için ideal olan bir korunma pozisyonu digger bir yatırımcıya uygun olmayabilir. Bu nedenle korunma stratejilerinin etkinliğini ifade ederken her bir yatırımcının risk karşısındaki tutumları ve ne tür bir korunma hedefinin bulunduğu belirlenmesi gereken bir faktördür. (Bolak;1998)

Yatırımcı profilleri literatürde 3 farklı şekilde ele alınmaktadır. Riski seven, riskten kaçınan ve riske karşı duyarsız yatırımcılar piyasada işlem yapan yatırımcılar için oluşturulan sınıflandırmadır. Bu bağlam ele alındığında bazı yatırımcılar için arzulanan en iyi durum tam belirlilik halidir. Bu türden bir yatırım tercihi olumsuz sonuçlardan korunmak için olumlu fırsatlardan da vazgeçmeyi içermektedir. Bunun yanısıra bazı yatırımcılar her koşulda en iyi sonucu elde etmeyi yani olumsuz durumdan korunurken olumlu gelişmelerden de yararlanmayı amaçlayabilirler. Bunu elde edebilmek için opsiyon ve digger finansal araç bileşimlerinden faydalanmak gerekir. Fakat bu şekilde oluşturulabilecek muhtemel portföylerin sayısı neredeyse sonsuzdur ve çözüm alanine daraltmak için yatırım özelinde olumsuz gelişmelerden kaçınma ve olumlu gelişmelerden faydalanma arasında bir denge oluşturulması gerekmektedir. (Bolak;1998)

Yatırım yapanın riske karşı tutumu gelecekle ilgili beklentileri ve tercihleri belirlendikten sonraki aşamada ihtiyaca yönelik uygun bir hedging(korunma) stratejisi geliştirilebilir. Bir sonraki aşama ise oluşturulan stratejinin etkinliğinin ölçülmesi ile alakalıdır.

Korunma oranının tespitinde farklı birçok model kullanılmaktadır. Bunlardan bazıları spot piyasada ve vadeli piyasada oluşan fiyatlar arasındaki ilişkinin zaman içerisinde sabit kalacağını savunurken bazıları ise iki piyasa arasındaki ilişkinin zaman içerisinde değişeceğini dikkate almaktadır. (Çelik- özdemir)

2.LİTERATÜR

Vadeli piyasalarda hedge (korunma) oranının tespiti ve etkinliğinin belirlenmesi ile alakalı ulusal ve uluslararası literatürde yer alan çalışmalar aşağıda özetlenmektedir.

Ederington (1979) çalışmasında 1976-1977 yılları arasında GNMA ve Tbill piyasaları için , Myers ve Thompson (1989) mısır ve soya fasülyesi vadeli işlem sözleşmeleri üzerinden yaptıkları çalışmalarında en küçük kareler yöntemi ile optimal korunma oranını tahmin etmeye çalışmışlardır. Fakat bu yöntemin bulguları Floros ve Vougas (2004) çalışmalarında vurguladıkları üzerine spot ve vadeli piyasalarda fiyatlar arası uzun dönemli eşbütünleşmenin görmezden geldiği sonucuna ulaşılmıştır.

İlerleyen süreçte yapılan çalışmalarda Cechetti (1988) Arch-(B-Arch), Ballie Myers (1991) Garch (B-Garch) Myers (1991) Garch, Park ve Switzer (1995) iki değişkenli Garch modelleri ile optimal korunma oranının tahmininin daha etkin sonuçlar verdiği sonucuna ulaşmışlardır.

Glosh (1993) ve Glosh ve Clayton (1996) yıllarında yaptıkları çalışmalarında optimal korunma oranının tespitinde hata düzeltme teriminin (ECM) kullanımının klasik yöntemlere göre daha doğru sonuçlar verdiği bulgusuna ulaşmışlardır.

Kenorgios vd. (2008) çalışmalarında 1992 ve 2002 yılları aralığında s&p 500 endeksi için vadeli korunma oranını en küçük kareler, hata düzeltme modeli, garch modeli, ECM Garch modeli ve E-Garch modeli ile tahmin etmeye çalışmışlar ve sonucunda ECM modelinin diğer yöntemlere göre daha iyi sonuç verdiği ulaşılmıştır.

Ülkemizde ise 2009 yılındaki çalışmalarında Aksoy ve Olgun (2009) İMKB 30 vadeli sözleşmesinin optimal korunma oranı üzerinde EKK , VECM ve GARCH modeli ile yaptıkları çalışmalarında en doğru sonuç veren yöntemin Garch modeli olduğu sonucuna ulaşmışlardır.

Evcı ve Kandir (2017) çalışmalarında 2005-2016 tarih aralığında USD/TL döviz kuruna ilişkin optimal korunma oranını tahmin etmek için en uygun modelin GED-EGARCH(1,2,2) olduğu bulgusuna ulaşmışlardır.

Çelik ve Özdemir (2014) çalışmalarında 1979 dan 2018 e kadar olan süreçte optimal hedge oranının tahminine ilişkin literatür taraması yapmışlardır. Çalışma sonucuna göre CCC-GARCH, DCC-GARCH, BEKK-GARCH gibi dinamik modellerin en doğru sonuç verdiği bulgusuna ulaşmışlardır.

3. VERİ VE YÖNTEM

Bu çalışmanın veri seti Borsa İstanbul (BIST)-30 spot endeks ve BIST-30 vadeli endeks sözleşmelerine ait 29.06.2012-02.10.2018 tarih aralığındaki günlük kapanış verilerinden oluşmaktadır³⁴.

Optimal korunma oranının ve korunma etkinliğinin ölçülmesinde kullanılan ilk model Ek Küçük Kareler (OLS) yöntemidir. Bu model Eşitlik-1'de verilmiştir.

$$R_{s,t} = \alpha_0 + \beta_1 R_{f,t} + \varepsilon_t \quad (1)$$

Bu eşitlikte, $R_{s,t}$ spot piyasa getirileri, $R_{f,t}$ vadeli piyasa getirileri, α_0 sabit terim ve ε_t hata terimidir. Taşıma maliyeti modeline göre vadeli piyasa spot piyasanın sapmasız bir tahmincisi olduğuna göre, α_0 ve ε_t 'nin sıfırdan farklı olduğu durumda korunma etkinliğini artıracak şekilde R^2 değerinin yüksek olması beklenir. Modelde β_1 katsayısı optimal korunma oranını vermektedir. (Singh,2017). OLS modeli uygulamadaki kolaylığına rağmen, hatalar arasındaki korelasyon probleminin olma ihtimali ve vadeli piyasa getirilerini içsel bir değişken olarak modele dahil etmemesi modelin eksiklikleri arasındadır.

³⁴ Veriler www.investing.com adresinden alınmıştır.

OLS'nin açıklanan bu eksiklikleri, değişkenler arasındaki eşbütünleşme ilişkisi ya da uzun vadeli ilişkinin yokluğunda Vektör Otoregresyon (VAR); varlığında ise Vektör Hata Düzeltme Modeli (VECM) ile giderilir. Bu çalışmada kullanılan VECM modeli Eşitlik-2'de verilmiştir.

$$\begin{aligned}\Delta S_t &= \alpha_s + \sum_{i=1}^K \beta_{si} \Delta S_{t-i} + \sum_{i=1}^K \theta_{si} \Delta F_{t-i} + \gamma_s W_{t-1} + \varepsilon_{st} \\ \Delta F_t &= \alpha_f + \sum_{i=1}^K \beta_{fi} \Delta S_{t-i} + \sum_{i=1}^K \theta_{fi} \Delta F_{t-i} + \gamma_f W_{t-1} + \varepsilon_{ft}\end{aligned}\quad (2)$$

Eşitlik-2'de α_s ve α_f sabit terimler, ε_{st} ve ε_{ft} beyaz gürültü sürecine sahip hata terimleri, β_s , β_f , θ_s , θ_f , γ_s γ_f parametreler, W_{t-1} ise bağımlı değişkenin, geçmiş dönem sapmalarını uzun dönemde nasıl düzelttiğini gösteren hata düzeltme terimleridir. γ_s ve γ_f düzeltme hızını gösteren parametrelerdir. $Var(\varepsilon_{st}) = \sigma_{ss}$, $Var(\varepsilon_{ft}) = \sigma_{ff}$, $Cov(\varepsilon_{st}, \varepsilon_{ft}) = \sigma_{sf}$ olarak ifade edildiğinde, VECM modeli tahmini sonucu, minimum varyans korunma oranı Eşitlik-3'te olduğu gibi hesaplanacaktır:

$$h = \sigma_{sf} / \sigma_{ff} \quad (3)$$

Korunma oranları hesaplandıktan sonraki aşamada korunma etkinlikleri hesaplanmıştır. Korunmamış ve korunmuş portföyün getirilerinin hesaplanması Eşitlik-4'te yer almaktadır:

$$r_u = S_t - S_{t-1} \quad (4)$$

$$r_h = (S_t - S_{t-1}) - h * (F_t - F_{t-1})$$

r_u ve r_h sırasıyla korunmamış ve korunmuş portföylerin getirisini gösterir. F_t ve S_t logaritmik vadeli ve spot fiyatlar, h ise optimal korunma oranıdır. Korunmamış portföyün varyansı ($Var(U)$) ve korunmuş portföyün varyansı ($Var(H)$) aşağıdaki şekilde hesaplanır:

$$Var(U) = \sigma_s^2$$

$$Var(H) = \sigma_s^2 + h^2 * \sigma_f^2 - 2h\sigma_{s,f} \quad (5)$$

Eşitlik-5'te σ_s ve σ_f spot ve vadeli fiyatların standart sapmasını, $\sigma_{s,f}$ spot ve vadeli piyasalar arasındaki kovaryansı gösterir. Ederington(1979) korunma etkinliğini, korunmuş portföyün varyansının, korunmamış portföye göre yüzdesel düşüş oranı ile ölçmüştür. Varyanstaki düşüş Eşitlik-6'daki gibi hesaplanmaktadır (Yang ve Allen,2005):

$$\frac{Var(U) - Var(H)}{Var(U)} \quad (6)$$

4.AMPIRİK BULGULAR

Analizden önce değişkenlerin durağanlığı Augmented Dickey-Fuller (ADF) (1981) birim kök testi ile test edilmiştir. Test sonuçlarına göre BIST-30 Spot Endeks (S) ve BIST-30 Vadeli Endeks (V) getiri serilerinin (logaritmik birinci farklar) durağan olduğu görülmüştür.

Tablo 1. ADF Birim Kök Testi Sonuçları

| Değişken | t-istatistik | Olasılık |
|----------|--------------|----------|
| S | -41.4664 | 0.0000 |
| V | -41.1065 | 0.0000 |

Değişkenlerin durağanlığı test edildikten sonra değişkenler arasında eşbütünleşme ilişkisi Johansen-Juselius (1990) eşbütünleşme testi ile test edilmiştir. Sonuçlar Tablo.2'de yer almaktadır.

Tablo 2. Eşbütünleşme Test Sonuçları

| İz İstatistiği Sonuçları | | | | |
|--|---------|----------------|-------------------|----------|
| Eşbütünleşme İlişkisi | Özdeğer | İz İstatistiği | 0.05 Kritik Değer | Olasılık |
| Yok | 0.0416 | 71.1348 | 15.4947 | 0.0000 |
| En fazla 1 | 0.0029 | 4.5054 | 3.8415 | 0.0338 |
| Maksimum Özdeğer İstatistiği Sonuçları | | | | |
| Eşbütünleşme İlişkisi | Özdeğer | İz İstatistiği | 0.05 Kritik Değer | Olasılık |
| Yok | 0.0416 | 66.6294 | 14.2646 | 0.0000 |
| En fazla 1 | 0.0029 | 4.5054 | 3.8415 | 0.0338 |

Not: Uygun gecikme uzunluğu Schwarz kriterine göre 1 kullanılmıştır.

Tablo.2'de yer alan sonuçlara göre değişkenler arasında iki eşbütünleşme ilişkisi olduğu görülmektedir. Uzun vadeli ilişkinin varlığında VAR modeli yerine VECM modelinin kullanılması uygundur.

Uygun model berirlendikten sonra Eşitlik-1 ve Eşitlik-2' de yer alan OLS ve VECM modelleri tahmin edilmiştir. Sonuçlar Tablo.3'de yer almaktadır.

Tablo 3. OLS ve VECM Tahmin Sonuçları

| | OLS | VECM |
|----------|-----------|------|
| α | -0.000004 | |
| β | 0.9544*** | |
| R^2 | 0.950703 | |

| | |
|------------|------------|
| α_s | 0.0031 |
| β_s | 0.0934 |
| θ_s | -0.1314 |
| γ_s | -0.0178 |
| α_f | 0.0003 |
| β_f | 0.3474*** |
| θ_f | -0.3766*** |
| γ_f | -0.1284** |
| R_s^2 | 0.0024 |
| R_f^2 | 0.0126 |

Not: *** ve ** sırasıyla %1 ve %5 istatistiksel anlam düzeyinde anlamlıdır.

OLS tahmin sonuçları incelendiğinde korunma oranının 0.9544 olduğu görülmektedir. VECM sonuçlarında ise vadeli endeksin bağımlı değişken olduğu modelde beta katsayısının pozitif ve istatistiksel olarak anlamlı olması, kullanılan örnekleme spot endeksin vadeli endekse öncülük ettiği ve onu yönlendirdiği görülmektedir. Hata düzeltme terimlerini ifade eden gama katsayıları her iki modelde de negatif olup vadeli endeksin bağımlı olduğu modelde istatistiksel olarak anlamlıdır. Bu sonuç kısa vadede her iki endeks arasındaki ilişkilerden sapmanın uzun vadede düzeldiği şeklinde yorumlanabilir.

Tablo.4'de OLS ve VECM tahmin sonuçlarından hesaplanan optimal korunma oranı ve etkinlikleri istatistikleri yer almaktadır.

Tablo 4. Korunma Oranları ve Korunma Etkinliği Performansları

| | OLS | VECM |
|--|-----------|-----------|
| Optimal Korunma Oranı | 0.954400 | 0.959993 |
| Korunmuş portföyün ortalama getirisi (%) | -0.000390 | -0.000566 |
| Korunmamış portföyün getirisinin varyansı (%) | 0.021115 | 0.021115 |
| Korunmuş portföyün getirisinin Varyansı(%) | 0.001104 | 0.001105 |
| Varyanstaki Düşüş (%) | 94.773330 | 94.768344 |

Tablo.4'te yer alan sonuçlara göre OLS ile hesaplanan optimal korunma oranı 0.9544 iken, VECM ile hesaplanan optimal korunma oranı 0.9599 olarak bulunmuştur. OLS yöntemi ile hesaplanan korunma oranında korunmuş portföyün ortalama getirisi, VECM ile hesaplanana göre daha iyidir. Benzer şekilde OLS ile hesaplanan korunma oranı ile korunan portföyün varyansı 0.001104 iken, VECM ile hesaplanan korunma oranı ile korunan portföyün varyansı 0.001105 bulunmuş olup, OLS yöntemi minimum varyansı sağlamıştır. Varyanstaki düşüş OLS yönteminde %94.7733 olurken, VECM'de ise %94.7683 olarak gerçekleşmiştir.

5.SONUÇ

Bu çalışmada spot BIST-30 endeksi ve vadeli BIST-30 endeksi verileri kullanılarak vadeli piyasalarda korunma oranı ve korunma oranı etkinliği OLS ve VECM modelleri ile test edilmiştir. Sonuçta, vadeli ve spot piyasaların entegre yani eşbütünleşik olduğu, OLS korunma oranı ile korunan portföyün getirisinin VECM korunma oranı ile korunan portföy getirisinden yükseke olduğu; OLS korunma oranı ile korunan portfö varyansının ise VECM korunma oranı ile korunan portföy varyansından düşük olduğu görüşmüştür. Bulgular OLS korunma oranının VECM korunma oranından daha yüksek performans gösterdiğini destekler niteliktedir.

KAYNAKLAR

- Aksoy, Gökçe-Olgun, Onur (2009), "Optimal Hedge Oranı Tahminlemesi Üzerine Ampirik Bir Çalışma: VOB Örneği". İktisat İşletme ve Finans Dergisi. Cilt: 24, Sayı: 274, 33-53.ss.
- Baillie, Richard T.-Myers, Robert J. (1991), "Bivariate GARCH Estimation of The Optimal Commodity Futures Hedge", Journal of Applied Econometrics. 6(2), 109-124.ss.
- Bolak Mehmet, (1998), Finans Mühendisliği Kavramlar ve Araçlar, Beta yayınevi İstanbul
- Bollerslev, Tim (1986), Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity, Journal of Econometrics, Vol. 31, pp.307-327.
- Cechetti, Stephen G.-Cumby, Robert E.-Figlewski, Stephen (1988), "Estimation of The Optimal Futures Hedge", Review of Economics and Statistics.70(4), 623-630.ss.
- Çelik İsmail, Özdemir Arife (2014), Vadeli İşlem Piyasalarında Optimal Hedge Rasyosunun Tahmini: 1979'dan Günümüze Bir Literatür Araştırması, Mehmet Akif Ersoy Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi, Cilt: 6 Sayı: 10 -Haziran
- Dickey, D. A., and W. Fuller, (1981), Likelihood ratio statistics for autoregressive time series with a unit root, Econometrica 49, 1057-1072.
- Evcı S., Kandir S.Y., (2017)"Optimal Hedge Oranı Tahmini: Dolar /TL Vadeli İşlem Sözleşmeleri Üzerine Bir Uygulama", TİSK Akademi, 12: 187-200,
- Ederington, L. H. (1979). "The Hedging Performance of the New Futures Markets. The Journal of Finance, 34(1): 157-170.
- Floros, Christos, Vougas, Dimitrios V. (2004), "Hedge Ratios in Greek Stock Index Futures Market". Applied Financial Economics. (14): 1125-1136.
- Ghosh, Asim (1993) "Hedging with Stock Index Futures: Estimation and Forecasting with Error Correction Model". The Journal of Futures Markets. 13 (7): 743-752.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Ghosh, Asim- Clayton, Ronnie (1996), "Hedging with International Stock Index Futures: an Intertemporal Error Correction Model". *Journal of Financial Research*. 19(4): 477-492.

Johansen, S., and K. Juselirs, (1990) "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Application to the Demand for Money", *Journal of Econometrics* 53: 211–244.

Kenourgios, Dimitris-Samitas, Aristeidis-Drosos, Panagiotis (2008), "Hedge Ratio Estimation and Hedging Effectiveness: The Case of the S&P 500 Stock Index Futures Contract". *International Journal of Risk Assessment and Management*. 9 (½): 121-134

Myers, Robert J. (1991), "Estimating Time-Varying Optimal Hedge Ratios on Futures Markets". *The Journal of Futures Markets*. 11 (1): 39-53.

Park, Tae H-Switzer, Lorne N. (1995), "Time-Varying Distributions and the Optimal Hedge Ratios for Stock Index Futures". *Applied Financial Economics*. (5): 131-137.

Singh, G. (2017). Estimating Optimal Hedge Ratio and Hedging Effectiveness in the NSE Index Futures. *Jindal Journal of Business Research*, 6(2): 108-131.

Yang, W., & Allen, D. E. (2005). "Multivariate GARCH Hedge Ratios and Hedging Effectiveness in Australian Futures Market", *Accounting & Finance*, 45(2): 301-321.

İŞE ALMA SÜRECİNDE ELDE EDİLEN SKORLAR İLE DENEME SÜRECİNDEKİ ÇALIŞANLARIN PERFORMANSI ARASINDAKİ İLİŞKİLERİNİN KUZAY KIBRIS TÜRK CUMHURİYETİ BANKALARI ÜZERİNE ARAŞTIRMA

ÖZET

Bu çalışmada özellikle Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti'nde kurulmuş ve faal olan özel bir bankanın işe alım süreci, işe alımda uygulanan metotlar, işe alım skorları ve işe alınan elemanların performanslarının işe alım skoru ile ilişkisi olarak irdelenmiştir. Çalışma literatür ağırlıklı nitel çalışma şeklindedir. Veriler personel sicil dosyalarındaki formlardan elde edilmiş olup gizli ve her hakkı saklı bilgiler olduğundan skorlama tablosunda personel ismi yerine sayılar kodlanmıştır. Yapılan araştırma neticesinde işe alım skoru yüksek olan personelin deneme süreci sonundaki skoru ile anlamlı ilişki tespit edilmiş ve buna ek olarak şahsi becerileri dikkate alınarak orta not ile işe alınan personelinde deneme süreci sonunda yükselen bir grafik çizdiği saptanmıştır, ve yine çalışma neticesinde işe alınan ancak deneme süreci sonunda çeşitli sebeplerle düşüş gösteren personelin ya işe adapte olamadığından yada kendi tercihine bağlı olarak işten durdurulması veya istifa etmesi söz konusudur.

***Anahtar Kelimeler;** İnsan Kaynakları, İşe Alım Süreci, Skorlar, Personel Değerlendirmeleri, Banka Personel Performansları.*

**THE RELATION BETWEEN RECRUITMENT PROCESS SCORES AND
PROBATION PROCESS PERFORMANCE: A RESEARCH OF BANKS AT NORTH
CYPRUS**

ABSTRACT

According to the researches there is a significant relationship between the high scoring personnel while recruiting which is in effect to the probation period and in addition to this the chart has raised, for the average potential personnel after the probation period. Also according to the researches it is relevant that the employee will be fired or resigned after the probation period due to the decreasing performance from any reason or the adaptation to their role in duty.

***Key words:** Human Resources, Recruitment, Scoring, Analysing Personnel, Bank Personnel Performance.*

1.GİRİŞ

Dünya ya paralel ülkemizde de gelişen global rekabet şartlarına bağlı olarak özellikle bankacılık ve finans sektöründe de performans yönetimi tamamıyla ve bilfiil uygulanmaktadır. Ülkemizde mevcut

* Lefke Avrupa Üniversitesi, İşletme Doktora, uguravcilar83@gmail.com

** Lefke Avrupa Üniversitesi, İşletme Doktora, sukruumarbeyli@hotmail.com

bulunan 22 banka buna bağlı olarak 233 şube ve yaklaşık 3049 personel ile ekonomimizdeki dar büyüme oranları ve ihracattaki tanınmamışlık ve ambargo koşullarına da bağlı olarak müşteri memnuniyeti ön planda tutulmak zorundadır. Özellikle 2008 yılından sonra İnsankaynakları bölümlerinin gelişmesi ve pazarlama bölümlerinin kurulması bankaların geleceği görme politikasını göstermekteydi. Gelişen rekabet ortamında sektörde ilk olmak, ürün geliştirmek ve teknolojiyi iyi kullanmak şüphesiz ki bir adım önde olduğunu gösterir. Tüm bu müşteri portföyünün gelişmesi ve yönetimi için bankalar performans yönetimi ve denetimi yapmak zorunda kalmaktadırlar. Bu şartlar gereğince uygulanan ve yapılan performans yönetimlerinin, skorlarının ödül ve prim sistemleri, eğitimleri, terfileri ve farkındalık yaratacak personeller yetiştirilmesi gibi personel gözlemleri ve kanaatlerini geliştirmek için işe alınma süreçlerindeki kararlardaki skorlar ile işe alındıktan sonraki performansların da doğru karar verildiği bu deneme sürecindeki kontrol skorlarının ve gelişimlerin izlenmesi performansların kontrolü ve bankaya ne kadar fayda sağlayabilen ve ileride iyi bir kariyere sahip olacak personellerin gelişmesi için geçen süreçler ele alınmaktadır. Buna ek olarak bazı bankalar ise direkt olarak Manager Trainee adı altında belirli aşamalardan geçilmek şartıyla direkt ileriki zamanlarda yönetim kadrosunda bulunacak personeli seçmektedir. Kamu bankalarına bakacak olursak bu yukarıda bahsettiğimiz 22 bankanın 2 si kamu sermayeli bankadır. Şüphesiz ki kamu bankaları özel sektör bankaları kadar hedef odaklı çalışmalarda organizasyonların devamı için her hal ve karda insan kaynakları politikaları geliştirmiştir. İşe belirli sınavlarla alınıp deneme süreci sonunda asil kadroya geçiş yapılmakta ve her yıl düzenli olarak sicil raporları ilgili amirler tarafından doldurulup yönetime sunulmaktadır. Bu da ilgili personelin terfisi, eğitimi, maaşı gibi önemli konular için esas baz alınacak kriterlerdendir.

2. BÖLÜM LİTERATÜR TARAMASI VE KAVRAMLAR

2.1. Performans Tanımı ve Önemi

Türk Dil Kurumu web sayfasında“Performans”, 1.Yapılan iş, uygulama, icraat; 2.Herhangi bir olayı veya durumu başarma isteği ve gücü; 3. Kişinin yapabileceği en iyi derece; 4. Herhangi bir eseri, oyunu, işi vb. ortaya koyarken gösterilen başarı” olarak tanımlanmıştır. Schuler’ ise performansı çalışanın işinde ne kadar iyi çaba gösterdiği olarak tanımlar(Schuler, 1995).

Bingöl 2006 yılı çalışmasında Performansı, işin icra düzeyi veya çalışanın davranış tarzıdır şeklinde tanımlamıştır. Aynı okuldan mezun, aynı eğitimi almış kişilerin çalışma yaşamındaki başarılarının farklı olması, birisi üst kademelere doğru çıkarken diğerinin aynı statüde kalması büyük ölçüde performansa bağlıdır. Performans sadece bireyin değil, aynı zamanda bir grubun ya da örgütün belirlenen zaman diliminde iş ile ilgili hedeflenen ve planlanan noktaya ne kadar varabildiğinin nicel ve nitel anlatımıdır. İş oluşturulan görevlerin ne derecede başarıyla yerine getirildiği belirlenmektedir (Mayatürk Akyol, 2011).

Elde edilen sonuçlar, olumlu ise verilen görevlerin yerine getirilmesi halinde yüksek performansla sonuçlanmıştır. Aksi takdirde performansın düşük olduğu kabul edilir. Üstün performans, başarı ile eş anlamlı olarak ifade edilir. Ancak üstün performans veya başarı kişisel, örgütsel ve çevresel birçok faktöre bağlıdır. Örneğin; konuşma, anlama, yazma vd. bireysel yetenekler ile bu yetenekleri bireyin gösterme isteği ve işletme içi çevresel koşullar, politikalar ve örgütsel koşullar performans üzerinde önemli etkiye sahiptir (Bingöl, 2006). Bireysel performans, beklenen amaçlara ulaşmak için çalışanın yetenek ve motivasyonu ile ortaya koyduğu davranış ve sonuçları ifade eder. Örgütsel performans ise kar, gelirler gibi finansal sonuçları, satışlar, pazar payı, tüketici memnuniyeti gibi pazar sonuçlarını, verimlilik, kalite ve etkinlik gibi yönetim sonuçlarını kapsar. Sikyr (2013), 2009-2010 yıllarında Çek Cumhuriyeti merkezli 30 büyük işletmede yaptığı araştırmada; örgütsel performans ve rekabetin çalışan performansı tarafından belirlendiğini ortaya koymuştur. Çalışanların sergilediği performansın belirlenmesi ve performansları hakkında bilgi edinebilmek için performans değerlendirilmesinin yapılması gerekir.

Organizasyonlarda çalışan performansının sistemli olarak ölçülmesine 1900' lü yıllarda A.B.D'ndeki kamu kurumlarında başlanmıştır. Türkiye'deki uygulamalar ise 80 yıl öncesi kamu kurumlarında başlamış ve özel sektörün de ilgisinin artması sonucu son çeyrek yüzyılda giderek derinleşmiş ve değer kazanmıştır (Kaynak ve Diğerleri, 1998: 205-206).

2.2. Performans Yönetimi ve Önemi

Performans yönetimi, uzlaşılan amaçlarla ilişkili olarak performansın incelenmesinin, geri bildirim ve hedef belirlemenin önemini ortaya koyan, yönetim biliminin belli bir alanıdır. Çalışanların, çalışma davranışlarını ve ürünlerini tanımlama, değerlendirme ve güçlendirme noktasında bütünleştirilmiş bir süreçtir. İyi geliştirilmiş performans yönetim süreci, örgütlerin bu öğeler olmaksızın örgüt tasarımı yapmamaya yönlendirir (Armstrong, 1996, s.262; Cumming ve Worley, 1997, s.370).

Performans yönetiminin genel amacı, örgütün etkinliklerini, kendi becerilerini ve katkılarına sürekli iyileştirmeleri için, bireylerin ve grupların sorumluluk üstlendikleri bir kültür oluşturmaktır (Bolton, 1997, s. 248; Cemaloğlu, 2002, s.183).

Performans yönetimi; örgüt, takımlar ve bireylerin daha verimli hale gelmesini amaçlar ve bilgi, beceri, gerekli yeterlikler, çalışma geliştirme planları konusuna ilgilendirir. Amaçlara, koşullara, planlara, anlaşmaya ve geliştirme planlarına bağlı olarak performans sürekli olarak incelemeyi konu alır. Öğrenme ve geliştirme üzerine odaklanır (Armstrong, 1996: 261; Canman, 1995).

M.S. 3.yüzyıl başlarında Wei Hanedanlığı'nda görevli bir değerlendirici, Çinli bir filozof tarafından, çalışanları yeteneklerine göre değil kendi beğenisine göre taraflı değerlendirdiği düşüncesiyle eleştirilmiştir (Murphy ve Cleveland, 1995). Asırlar sonra İspanyol rahip Ignatius Loyola (1491-1556) Cizvit tarikatı üyelerinin sorumluluklarını değerlendirmek amacıyla bir performans

sistemikürmüştür (Öztürk, 2010). Aynı yıllarda Osmanlı İmparatorluğunda devlet işlerinde doğrudan bir performans yönetimi sistemi uygulanmasa da benzer uygulamalar söz konusudur. Padişah emirleri niteliğinde olan "i'lam" ve işler hakkında bir özetleme raporu olan ve padişah onayına sunulan "telhis" önemli yönetim belgeleridir. Örneğin; Mimar Sinan, 1580-96 yılları arasında yaklaşık 9 yıl sadrazamlık yapmış olup telhislerinde; kadıların yolsuzluklarını, padişahemri olmaksızın toplanan vergileri miktarıyla belirtir ve kadıların görevlerinin aksine hareket etmesi ve isyanı engellenir (İnalçık, 2014a).

Etkili performans yönetimi, firma başarısını çalışanları başarıya teşvik ederek sağlar. Eğer çalışanlara görevlerinin neler olduğu tam olarak açıklanırsa, bilinçli bir yönlendirme ve bu yönlendirmenin bir getirisi olarak da herkesin yapması gereken işi bildiği bir ofis ortamı oluşur. Bu tip bir ortamda işler daha hızlı ve verimli ilerlerken, esnek ve ılımlı ortam da çalışanların yaratıcılıklarının artmasında etkili olacaktır. Çalışanların açık görev tanımlarına sahip olmadığı durumlarda, görev dağılımı istikrarlı olmaz ve çalışanların sorumlulukları sürekli olarak dağılır. Bu hem performanslarının düşmesine hem de zaman yönetiminde aksamalar olmasına neden olabilir (<http://www.kariyer.net/kariyer-rehberi/performans-yonetimi/>).

2.3 Bankalarda Performans Yönetimi

Performans yönetimi sisteminin temel amacı, çalışanların şirket hedefleri doğrultusunda etkin bir şekilde çalışmalarını sağlamaktır. Dolayısıyla, performans yönetimi sisteminde, çalışanların şirket hedefleri doğrultusunda etkin bir şekilde çalışmasını sağlayacak araçların ve yaklaşımların geliştirilmesi ve kullanılması esastır (Bayar, 2004). Performans yönetimi sisteminin ana unsuru, çalışanların performansının takibini ve geliştirilmesini amaçlayan performans değerlendirme sistemidir. Performans değerlendirme sisteminin amacı incelendiğinde, aşağıda yer alan üç ana noktanın göze çarptığı görülür, performans yönetim sisteminin organizasyonların daha etkin çalışmasını sağlayan bir dizi amaçları bulunmaktadır.

A) Yönetimsel Amaçlar: Performansın yönetim sürecini uygulayan amir, performans yönetimini çalışanın başarısını açığa çıkarmak ve sonucunda iş ve işveren için gereklidüzenlemeleri yapmak için uygular. Bir organizasyonda ücretlendirme, yükseltme, transfer ve isten çıkarma gibi yönetimsel kararların oluşturulmasında ortaya çıkmaktadır.

B) Geliştirmeye Yönelik Amaçlar: Performans yönetiminin amaçlarından bir tanesinde işe alınan personelin işe alınma sürecinden itibaren işe olan yetkinliklerinin hangidüzeyde olduğunun belirlenmesi ve bu konu üzerinde personelin kendisini ve işbecerisinin yükseltilmesinin sağlamasıdır. Geliştirilmeye yönelik amaçlar kariyer planlamasında eğitim-geliştirme programlarının hazırlanmasında danışmanlık vereberlik desteğinin verilmesinde güçlü ve güçsüz yönler ile ilgili geri bildirimlerde bulunulmasını ön plana çıkarmaktadır.

C) Araştırmaya Yönelik Amaçlar: Performans yöneticisi hangi departmanda olursa olsun çalışanın yapmış olduğu işe karşı tutumunu iş üzerindeki olumlu olumsuz düşüncelerini ve işi yaparken uyguladığı davranışlarının sebebini belirginleştirmek durumundadır. Personelin işe tatmini motivasyon düzeyinin belirlenmesinde gelecekteki hedeflerin saptanmasında performans düzeyini etkileyen faktörlerin ortaya çıkarılmasında ve çalışanların performansı ile organizasyonun amaçları arasındaki ilişkinin incelenmesinde gündeme gelmektedir. Bu amaçlar;

- Organizasyonel hedeflerin açık tanımlanmış bireysel hedeflere dönüştürülmesi,
- Hedeflerin gerçekleştirilmesi için gerekli olan performans kriterlerinin belirlenmesi,
- Belirlenen kriterlere göre çalışanların zamanında ve adaletli değerlendirilmesi,
- Performans değerlendirme sistemi, üstler ve altlar arasındaki ilişkilerin iletişimin geliştirilmesini, çalışanların performans sorunları ile baş edebilmelerini sağlayacak bir yapı ortaya koyar.

Çalışanların performanslarının altı aylık ve/veya bir yıllık dönemlerle düzenli olarak değerlendirilmesi; yöneticilerin, çalışanların iş tatmini, kariyer hedefleri, eğitim ihtiyaçları ve diğer kişisel sorunları hakkında bilgi sahibi olmalarına sağlar (Cantekinler , 2007).

Performans değerlendirmesi, çalışan kabiliyetlerinin işin nitelik ve gerekliliklerini ne ölçüde karşıladığını araştıran veya kişinin işteki verimliliğini belirlemeye yönelik nesnel analizler olarak da tanımlanabilir. Performans değerlendirmesi dengeli bir ücret sisteminin uygulanmasında, çalışanların terfi, rotasyon ve eğitim ihtiyacının belirlenmesinde, çalışan seçim ve atanmasında başvurulan önemli bir işlemdir (Sabuncuoğlu ve Tokol, 2013).. Eğer performans ölçümü veri toplama ve raporlama faaliyeti gibi basit bir şekilde görülürse, o amacına çok az hizmet edecektir (Waxın ve Bateman, 2009). Performans yönetimi, çalışanların ve grupların performanslarının geliştirilmesiyle örgütsel performansın geliştirilmesi için yürütülen sistematik bir süreçtir (Armstrong, 2006).

2.3.1 Performans Değerlendirmesi Amaç ve Faydaları

Bir örgütte çalışan herkes uzun bir zincirin halkalarıdır. Zincirin hangi kısmında standartlara uygun iş çıkmadığının ve hangi halkanın zayıf olduğunun farkına varılıp, düzeltme yoluna gidilebilmesi, zincirin diğer halkalarının olumsuz etkilenmesini engeller. Performans değerlendirmesi, yöneticinin işi ve o işi yapan personeli yakından tanımaya olanak verir. Yapılan çalışmalara sonucunda personel hakkında pek çok bilgi toplayan yönetici, personel hakkında objektif karar verebilir. İş beklentileri ve sonuçları hakkında yönetici ve çalışan arasında iyi bir iletişim kurularak geliştirilen yöntemler veya yeni fikirler için fırsatlar yaratılmış olur. Performans iyi bir şekilde değerlendirildiğinde, çalışanlar işi nasıl yaptıklarının bilincine varırlar ve endişelenmekten kurtulurlar. Personel performansları hakkında zamanında geri bildirim aldıklarından verimlilikleri ve iş tatminleri artar. Çalışanlar ile iki yönlü iletişim

kurulduğunda amaçlar açıklık ve netlik kazanır. Böylece personelin odaklanması ve başarılı olması kolaylaşır. Profesyonel olarak performans değerlendirmesi öğrenmek yönetim becerilerinin geliştirilmesi ve sorumluluğun artırılması için mükemmel bir hazırlıktır (Cusins,1997).

Objektif olarak uygulanan ve objektif ölçütlere dayanan bir performansdeğerlendirme yüksek moral ve organizasyona güven duygusu yaratacaktır. Örneğin, iyiniyetini ve çalışma gücünü ortaya koyan bir çalışan, düşük performanslı ve isteksiz bir çalışanla aynı şekilde değerlendirilmek istenmez. Bu motivasyon bozukluğu, çalışma isteğinde azalmaya sebep olur. Ancak doğru bir performans değerlendirme ile çalışan eksikliklerini giderme ve yeteneklerini geliştirmeye çalışır. Etkin bir ücretlendirme(ekonomik ve psikolojik) işi özendirir. (Cantekinler, 2007).

2.4. İş Analizi ve Faktör Seçimi

İş analizi ve benzerleri yapan her çalışanın ne yapması gerektiğini, biçimsel olarak belirleyen kesin standartlar ortaya konulur. Uсталık, çaba, sorumluluk ve çalışma koşulları belirlenir. Objektif kriterlere göre yapılacak bir iş analizi performans değerlendirmesi ile birlikte toplam ücretin belirlenmesini sağlayacaktır. Değerlendirmeye temel alınacak faktörlerin işin özelliğini ve sorumluluk düzeyine uygun olarak seçilmelidir. İşçi, ofis görevlileri ve yöneticiler için farklı faktörler kullanılmalıdır (Barutçugil, 2002).

- i Faktör seçiminde sadece iş verimi değil çalışan davranışları da göz önüne alınmalıdır.
- ii Faktörler açık ve anlaşılır olmalıdır.
- iii Faktör sayısı sınırlandırılmalı ve onu geçmemelidir. (1 iyi, 2 kötü, 3 Orta vs.)

Genel değerlendirmeye temel olan faktörler çalışanın temel nitelik ve niceliği, işbirliği ve yeteneği, bireysel özellikler, bireyin ilişki ve davranışlarıdır. Eğer yönetici için değerlendirme yapılıyorsa nitelik ve nicelik, planlama, organizasyon, liderlik, sorumluluk alma, güdüleme, bilgi toplama, değerlendirme, bilgilendirme, yönetici geliştirme gibi faktörler göz önüne alınarak değerlendirilir(Cantekinler, 2007).

2.4.1 Değerlendirmecilerin Seçimi

İş görenlerin performans değerlendirmesini yapacak kişilerin çalışanın davranış, tutum ve iş üzerindeki etkinliğini en iyi şekilde analiz edecek olan yönetici seçilmelidir. Çalışanların performans değerlendirmesini genellikle ilk amir(yönetici) durumunda olan kişi yapar. Ancak çalışma durumuna, organizasyonun temel ve hiyerarşik yapısına ve ilk amirin değerlendirmeyi yapamayacağı zamanlarda çalışanın performans değerlendirmesini, üstlerinden bir tanesi, çalışma arkadaşları, çalışanın kendisi, astları veya işletme dışındaki kişiler üstlenmektedir. Performans değerlendirmesi işletmelerde genellikle ilk amir konumundaki yöneticiler ile yapılmasına rağmen, değerlendirmenin yöneticinin dışında ikinci bir amir tarafından gözden geçirilmesi ve onaylanması gerekir. Yöneticiler, genellikle değerlendirme

amiri olarak tek baslarına değerlendirme yapmaktadırlar. Altında çalışan sayısı az olduğu durumlarda olumlu sonuçlar elde edilmesine rağmen bazı durumlarda yönetici değerlendirmecilere de ihtiyaç duyar. Çalışma arkadaşlarının değerlendirilmesi durumunda ilişkiler ve arkadaşlık grupları göz önünde bulundurulmalıdır. Astların değerlendirilmesi de performans değerlendirmede başvurulan yöntemlerdendir. Özellikle büyük kuruluşlarda iyi sonuç vermektedir. Çok fazla kişi vardır ve değerlendirme bunların ortalamasına göre yapılır. Ancak terfi vezam gibi kararlar astların yumuşamasını sağlar. Çalışanın kendini değerlendirmedeki amaç çalışanın güdülenmesi ve savunmasını önlemektir ancak güvenilirlik ve geçerlilik etkisi yoktur (Cantekinler, 2007).

2.4.2. Değerleme Dönemlerinin Belirlenmesi

Değerlendirme dönemleri yılda 4 kez yapılmaktadır. (3'er aylık çeyreklerle) Bu takvimler yönetim kurulu tarafından önceden belirlenerek ilgili genelge ve yönetmenliklerde belirtilmiştir. Ancak yılda bir kere veya altı ayda bir olarak uygulayan kurumlarda mevcuttur.

2.4.3 Yönetici ve Çalışanlara Bilgi Verilmesi

Genelge ve yönetmenliklerde yazılan maddelerdeki uygulama takvimleri önceden personel ve yöneticilere bilgi verilerek organize edilmektedir. Gerekli her türlü uygulama ve zamanları iş planı da yapılarak personellere deklere edilmektedir. Böylece izin zamanları da bu şekilde ayarlanmaktadır ve engel olmamaktadır.

2.5 Personel Alımı

Bankalarda personel alımı önemlidir Kesinlikle bankanın gelecekteki temsiliyeti ve rekabet gücü, politikaları ve hedeflerine ulaşarak yeni ürünler çıkarması, piyasadaki itibarı ve gelişimi kesinlikle ve kesinlikle işgücü ve çalışanlarına bağlıdır. Personel alımında iyi analiz yapılması ve değerlendirmesi sözlü ve yazılı mülakat yapılarak değerlendirilip her çeyrekte yakından takip edip değerlendirmek bankaların vazgeçilmez politikalarıdır. İşgücü piyasası; teknolojik gelişmeler, ekonomik krizler, üretim kalıplarının değişmesi, bilgi toplumuna geçiş ve hizmet sektörünün ön plana çıkması gibi sebeplerle yapısal değişime uğramıştır. İşgücü piyasasının değişen yapısı içinde kadınlar istihdama katılma oranı açısından artış gösterebilir de istihdam edildikleri iş tanımları genellikle düşük statülü ve düşük ücretli işler olmuştur.

Kadınlar işgücü piyasasında toplumsal kadın-erkek rollerinin devamı olan cinsiyetçi yaklaşımların gölgesinde kariyer fırsatlarından uzak kalmaktadırlar. Kadının işgücü piyasasında cinsiyetçi kariyer farklılaşması yaşamasının temel sebepleri toplumsal önyargılar, kadının toplumsal rolleri ve fırsat eşitsizliği olarak özetlenebilir. Hizmet sektörü içinde en dikkat çeken sektörlerden biri olan bankacılık sektöründe, istihdam edilenlere cinsiyet açısından bakıldığında, yaklaşık %74 kadın çalışanın olduğu görülmektedir.

Bu olumlu gibi görünen orana rağmen kadınların bankacılık sektöründe üst düzey yönetici kadrolarında istihdam oranlarına bakarsak sadece yaklaşık %25 civarında olduğu bilinmektedir. Genelde işgücü piyasasında, özelde ise bankacılık sektöründe kadınların aleyhine bir cinsiyetçi kariyer farklılaşması söz konusudur. (Karataş, 2013)

2.5.1 Personelin Eğitimi

Bankaya ilk alınan personelin takibinin iyi yapılması gerekmektedir. İlk gözlemler çok önemli olup yeni bir personelin banka kültürü ve kurallarını uygulaması ve öğrenmesi daha sonraki motivasyonu ve hedefleri açısından personelin geleceğini belirlemektedir. Banka tarafından belirlenmiş olan mesai başlama ve bitiş saatlerine uymalı; Bankanın İnsan Kaynakları Yönetmeliği'ndeki uygulama ve esasların sorumluluğu ile hareket etmelidir.

Banka” Profesyonel Görünüm Kuralları” çerçevesinde iş giysisi ve genel görünüm kurallarına ve “İş Etik Kuralları” ve “Disiplin Kuralları”na uygun hareket ederek kendini göstermelidir. Kişisel çıkarlarıyla Bankanın çıkarları arasında çatışma içerecek durum ve ilişkilerden kaçınması ve bunun yanında banka yöneticisi olduğu zaman ise kapsamlı ve stratejik düşünme, etkin karar alma, iş performansını etkin yönetme, planlama ve organize etme, banka içi ve dışı etkin ilişkiler kurma, inisiyatif alma, temsil ve müşteri odaklılık konusunda kendisinden ne beklediğinin bilinmesi ve buna uygun davranış ve duruş sergilemesi kariyerinin de belirlemektedir. Kuruma ve müşterilere yönelik bilgi güvenliğinin korunması, çalışanlarının bilgi güvenliği ve gizliliğine uygun çalışmalarını takip etmesi ve mesleki yayınları takip ederek, kendini sürekli yeniler, kurumun yönlendirdiği eğitimlere katılması ile geçen tüm bu süreç personelin eğitiminin ana maddesi ve baştaki süreçleridir.

2.5.2 Personel Yönetiminin Uygulanmasındaki Araçların Belirlenmesi

Personel yönetimi çok kolay olmayan bir süreçtir. Buradaki uygulama araçlarından bazıları ise personelin eksiklerinin belirlenmesi için yapılan ortak çalışmalar ve sınavlar, Eğitici kurslar, uzaktan eğitim, takım çalışmasındaki tavırlarının gözlemlenmesi, Mevcut kullandığı sistem ve yan programları, performans yönetim anketleri gibi yöntem ve çeşitli araçlarla takip edilip kontrolü yapılmaktadır.

2.5.3 Vizyon ve Strateji Belirleme

Şube personeli seçme sürecinde Genel Müdürlük ve İnsan Kaynakları Bölümü ile mülakat süreci ile başlayan vizyon ve strateji belirleme çalışmalarını bir bütün olarak değerlendirirsek genel olarak bankacılık sektöründe tüm davranış ve hareketlerin takip edilmesi ve gözlemlenmesi önemli bir noktadır. Şube çalışanlarının işe geliş-gidiş saatlerini denetimi, Çalışanlarının yıllık izinlerini kanuni sürelerle uygun olarak ve bankadaki faaliyetleri aksatmayacak şekilde planlamalarının takibi; Çalışanların işyeri kurallarına, yönetmeliklerine ve disiplin kurallarına uygun hareket etmesi konusunda gözlemlenmeleri, uygun olmayan davranışın uyarılmasını sağlamak iyi takip neticesinde olmaktadır.

Çalışanların eğitim ihtiyaçlarının tespit edilmesi, yönetim tarafından verilen eğitimlere katılmaları; Şube içinde birbirini destekleyen, birlikte kazanmak ilkesine dayanan ortak bir takım kültürü yaratılması çok önemlidir. Çalışanlarının istek ve sorunlarını dinlenerek, uygunluk durumuna göre çözümler üretilip, gerekli zamanlarda yol gösterilmesi; Bankanın içinde çatışmaların yönetilmesi ve uzlaşmaların sağlanması. Bankanın diğer bölümlerle iyi ilişkileri kurması ve işbirliği içinde olmasına önem verilmesi; İşe yeni başlayan personelin bölüm içi uyum eğitiminin verilmesini sağlanmalıdır. Çalışanlarının mesleki gelişimleri, tecrübe kazanmaları konusunda destek olunması; İnsan Kaynakları Bölümü tarafından belirlenen prensipler çerçevesinde, kendisine bağlı çalışanların görevde yükselmeleri konusunda öneride bulunup çalışanları motive etmesi büyük bir katkı koymaktadır.

Bankanın tüm biriminde çalışan personelin performanslarını sürekli ve düzenli takip etmek gerekmektedir. Olumlu/olumsuz davranış, iyi/düşük performans ve fark yaratan başarıyı/verimsizliği ortaya çıkararak, gerekli önlemlerin alınması için yönetim ile koordinasyon içinde çalışılmalı, takdir ederek veya uyararak, ekibinin motivasyonunu güçlü kılmak başlıca maddelerdir.

2.5.4 Hedef ve Kotalar

Bankalarda verilen hedef ve kotalar bankaların büyüme politikalarına bağlı olarak değişmektedir. Bu dağılımlar yapılırken öncelikle şube sayısına ve bölgesine bakılarak bu hedefleri gerçekleştirecek personellerin şubelerdeki dağılımları da göz önünde bulundurularak dağılımlar yapılmaktadır.

Ekonomik koşullar, ülkedeki banka sayısı, nüfus, pazarlama politikaları, ulaşılabilecek kesim, pazarlanmak istenen bankacılık enstrümanları göz önüne alınarak kotalar da şube bazlı olarak verilmektedir. Şube de ise bu kota ve hedefler tek tek personelin görev tanımına ve mevcut bulunduğu pozisyona göre verilmektedir. Hedefe ulaşmak takım işi olarak alındığında daha önemlidir. Çünkü bütün kendini oluşturan parçalardan daha büyüktür. Odaklanma ve rekabet gücü ile de orantılıdır. Daha sonra 3 er aylık çeyreklerde yılda 4 kez bu hedef ve kotalar denetlenmektedir.

2.5.6 Performans Yönetiminde Değerlendirme Süreci

Yapılan tüm performans değerlendirmeleri göz önünde bulunarak alınan skora göre değerlendirme yapılmaktadır. Genellikle bunun yanında İnsan Kaynakları 360 derece değerlendirmeyi kendi içinde sözlü olarak yapıp bilgilerde elde etmektedir. Ülkemizde genellikle bu bilgileri gizli olarak yapmaktadırlar. Bu bilgiler ışığında ise diğer skorlarla karşılaştırma yapıp sicillere işlenmektedir. 4 çeyrekte yapılan değerlendirmelerin tutarlı olup olmadığına da bakılarak personelin durumunu ortaya çıkararak eğer farklı bir değerlendirme yapılmayacaksa ki bunlardan bazıları rotasyon, şube değişikliği veya bölüm değişikliği, eksik eğitim veya gelişim yönleridir; Gerekli kararlar verilmektedir.

2.5.7 Performans Geribildirimi

Performans geribildirimleri elde edilen ve alınan skorların hemen değerlendirilmesinden sonra her çeyrek sonunda personel ile paylaşarak gerekli konulardaki eksikleri ve başarıları yapılması gereken eğitim ve eksiklerin tamamlanması için alınacak olan aksiyon planları da dahil tüm sonuçlar konuşularak gerekli her türlü sonucu insan kaynakları ya da gerekli durumlarda ise bağlı olduğu müdürü alınmaya çalışılmaktadır.

3. BANKADA PERFORMANS YÖNETİM VE UYGULAMALARI

3.1. Bankada Performans Yönetim ve Uygulamaları

Bu bölümde uygulamaların bankacılık sektörü uygulamalarından bahsedilecektir.

3.1.1 Uygulamanın Amacı

Uygulamalar bankaların kaderini belirleyecek işgücünün kontrol altına tutularak istenilen verimi vermesi ve kontrollü bir şekilde politikalarına uygun olarak sağlıklı bir büyümeye ulaşip bir marka değerine ulaşip bankanın sürdürülebilir bir kar yapısını oluşturup sürekli olarak gelişmesi ve piyasadaki pozisyonunu koruması ve ilerlemesi açısından çok büyük bir önem taşır. Başarı bu sayede gelmektedir. Dolayısı ile sürekli olarak ödül ve ceza yani performans yönetimine bağlı olarak gerekli önlemlerin alınması kaçınılmazdır. Primler verilirken uyarılarında verilmesi kaçınılmazdır.

3.1.2. Uygulamanın Yöntemi

Uygulamalar performans değerlendirme anket yöntemi ve 360 derece sözlü araştırma ile yapılmaktadır. Bunun dışında herhangi bir art niyet olmaması için tüm sonuçlar personel ile paylaşılmaktadır. Gerekirse sorunlar için ekstra olarak toplantı da yapılmaktadır. Tüm bankalarda genellikle yapılan performans değerlendirme ve analiz yöntemleri birbirleri ile örtüşmektedir.

4. ARAŞTIRMA YÖNTEMİ

4.1 Araştırmanın Yöntemi

Bu araştırma nitel olup, mülakat ve personel sicil dosyalarında var olan raporlardaki bilgiler toplanarak yazılmıştır.

4.2 Araştırmanın Evren ve Örneklemi

Araştırma KKTC'de kurulmuş olan 6 şubeli ve toplam 54 çalışanı olan özel bir bankayı kapsamaktadır. Ulaşabildiğimiz veri sayısı 50 dir. Bu rakam ise Yamane Toro'nun 1967 yılında bulmuş olduğu $n = \frac{N}{1 + N(e)^2}$ formülüne göre $n = \frac{54}{1 + 54 * 0,0025} \ggg 47.58$ örnek evren temsiliyeti için geçerli olan miktar olarak kabul edilmiştir.

4.3 Araştırmanın Varsayımları

Bu araştırmada aşağıda yer alan üç hipotez sınanacaktır;

H1: İşe Giriş Skoru, iyi veya yüksek olan personelin, deneme süresi sonucu gösterdiği performans arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H2: İşe giriş skoruna bağlı olarak personelin öne çıkan özelliklerine göre orta olan bir skor ile işe alınan personel kendisini geliştirerek iyi skor elde etmektedir.

H3: Bankacılık sektörünün mevcut yapısı itibarı ile deneme süresi sonuç skorları, giriş skoruna göre düşük olan personellerin işe devamı söz konusu değildir.

5. ARAŞTIRMA SONUCU ELDE EDİLEN BULGULAR

5.1 Performans Değerlendirme Takvimi ve Genel Uygulama İlkeleri

Bankanın belirlediği yılda 4 defa yapılan (3'er aylık dönemler) ile yapılacak olan değerlendirme anketleri ile çıkan sonuçlara göre yapılan bu değerlendirme skorları standart olarak yapıp personel ile paylaşılmaktadır. Genel olarak aynı performansı ölçtüğünden dolayı her zaman tutarlı çıkmaktadır ve güvenilir bir ilkeye dayalıdır. 360 derece değerlendirme ile de tekrardan gizli olarak desteklenmelidir. Personel ile paylaşılması ise şeffaf ve güvenilirlik ilkelerini artırarak doğruluk göstergesidir.

5.2 Performans Değerlendirme Takvimi

Performans değerlendirmeleri yılda 4 kez yapılmaktadır. Her 3 aylık dönem (toplam 4 çeyrek) düşünüldüğünde Mart, Haziran, Eylül ve Aralık ayları sonunda performans değerlendirmeleri yapılmaktadır. Bu takvimler, çalışma alanımız olan banka tarafından kesin ve sürekli olarak değişmeden titizlikle yapılmaktadır.

5.3 Performans Göstergeleri

Bankadaki Personel sicil dosyasından her hakkı saklı kalmak ve isim yerine numaralandırma kullanmak şartı ile elde ettiğimiz skor tabloları aşağıdaki şekildedir:

Tablo1. Performans Göstergeleri

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| Personel | İşe Giriş Skoru | Deneme Süresi Sonu Skoru | İşteki Durumu |
|----------|-----------------|--------------------------|---------------|
| 1 | 82 | 87.25 | Devam |
| 2 | 76,5 | 42.5 | Durduruldu |
| 3 | 63,25 | 70,25 | Devam |
| 4 | 71 | 75.5 | Devam |
| 5 | 67 | 48.75 | İstifa Etti |
| 6 | 91,25 | 93 | Devam |
| 7 | 80 | 82 | Devam |
| 8 | 75,5 | 78,25 | Devam |
| 9 | 90 | 92 | Devam |
| 10 | 61 | 53,25 | İstifa Etti |
| 11 | 72 | 55.5 | Durduruldu |
| 12 | 68,5 | 71 | Devam |
| 13 | 71 | 73 | Devam |
| 14 | 73,25 | 75 | Devam |
| 15 | 82,5 | 85 | Devam |
| 16 | 74,75 | 76,25 | Devam |
| 17 | 88 | 89 | Devam |
| 18 | 95 | 95,25 | Devam |
| 19 | 65,75 | 68,25 | Devam |
| 20 | 71 | 73 | Devam |
| 21 | 68,25 | 71,75 | Devam |
| 22 | 83 | 84,5 | Devam |
| 23 | 61,75 | 48.5 | İstifa Etti |
| 24 | 82 | 84 | Devam |
| 25 | 88 | 89 | Devam |
| 26 | 64,25 | 57 | Durduruldu |
| 27 | 73 | 74,25 | Devam |
| 28 | 84 | 85,50 | Devam |
| 29 | 75,75 | 77,25 | Devam |
| 30 | 95 | 96 | Devam |
| 31 | 68,75 | 72,25 | Devam |
| 32 | 77 | 78,25 | Devam |
| 33 | 82,75 | 84 | Devam |
| 34 | 78 | 79,25 | Devam |
| 35 | 72 | 73,25 | Devam |
| 36 | 66,5 | 72 | Devam |
| 37 | 72,5 | 73,25 | Devam |
| 38 | 82 | 83,5 | Devam |
| 39 | 73,5 | 77 | Devam |
| 40 | 76 | 77 | Devam |
| 41 | 82 | 83 | Devam |
| 42 | 74 | 75,25 | Devam |
| 43 | 69 | 70,25 | Devam |
| 44 | 84,5 | 86,25 | Devam |
| 45 | 88 | 89 | Devam |
| 46 | 62,5 | 74,25 | Devam |
| 47 | 71 | 74 | Devam |
| 48 | 88 | 88,75 | Devam |
| 49 | 65,5 | 58,25 | İstifa Etti |
| 50 | 71.5 | 72,75 | Devam |

5.4 Performans Değerlendirme Notunun Hesaplanması

Performans skoru elde edilirken; Sırasıyla birinci, ikinci ve üçüncü ve dördüncü sicil amirleri tarafından verilen toplam puanlar hepsi toplanır ve 4 e bölünerek performans skoru elde edilir. İşe alım skoru ise mülakata katılan sınav heyeti tarafından sorulan sorulara verilen cevap karşılığı alınan notların ortalaması şeklinde hesaplanır. Ancak son zamanlarda sözlü mülakata ek olarak yazılı sınav uygulamalarına da başlamışlardır.

5.5 İş Sonuçlarına Dayalı Performans Notu

Hali hazırda KKTC'de bankalarda uygulanmakta olan sicil değerlendirme formlarında sorular çeşitlenmiş olup her kısım ilgili yeteneği ölçmeye yönelik olsa da genel kümülatif ortalama nota çok etki etmektedir.

İş sonucuna göre skor belirlemede sorulan sorular özellikle iş görenin iş ile ilgili konularını kapsar bu sorular;

- Bulduğunuz mevki ile ilgili görevlerde inisiyatif alma,
- Mevkinize uygun verilen görevlerde işi sonuçlandırma ve takibi,
- İş ile ilgili enstrümanları ne kadar etkin kullanabildiği,
- İş ne kadar sürede sonuçlandırdığı,
- İş ile ilgili konularda ne derecede bilgili olduğu

Şeklinde bir takım sorulardır. Bu sorular 0-100 arası puanlanmakla beraber kümülatif sonuca etki etmektedirler.

5.6 Davranışlara Dayalı Performans Notu

Bir önceki maddede belirtildiği gibi sicil değerlendirme formlarının soru kısmından bir kısmı da davranışla ilgilidir. Bu kısım soruları da kendi başarılarına değil de kümülatif sonuca etki etmektedir. Bu sorular da 0-100 arası not şeklinde verilir. Birkaç soru örneği aşağıda belirtilmiştir.

- Mesai arkadaşları ile ilişkileri ne durumdadır,
- Amirleri ile ilişkileri ne durumdadır,
- Dıştan gelen insanlarla ilişkileri ne durumdadır (halkla ilişkileri),
- Mesai saatlerine uyumu ne durumdadır.

5.7 Toplam Performans Notu

Bütün sicil formunda var olan sorular cevaplandıktan sonra ortaya çıkan sonuçtur 60 in altı zayıf addedilmektedir. Bu notlar terfi de maaş artışlarında yer değişme ve tayinlerde hatta işten kovulma da bile hayati önem arz etmektedir.

5.8 Başarı Skorlarının Tespiti

Tablo 2. Başarı Skor Tespiti

| PERFORMANS DEĞERLENDİRME NOTU | BİREYSEL BAŞARI DERECE |
|-------------------------------|------------------------|
| 0-50 | Yetersiz |
| 51-59 | Gelişmesi gerekli |
| 60-69 | Orta (Geçer) |
| 70-79 | İyi |
| 80-100 | Yüksek |

5.9 Birinci, İkinci, Üçüncü ve Dördüncü Sicil Amirleri

Ülkemizdeki yerel olan özel bankaların genellikle işe girişlerde sözlü mülakat yaptıkları ortaya çıkmıştır. Yeni yeni bazıları yazılı sınava başlamıştır. Yerli özel bankalar ile yapılan mülakatlar da birçok konuda işe alınacak personel adayı mülakatta sorulan sorular ve yapılan analizlerle elde edilen skorlar üzerinden değerlendirilmektedirler.

Mülakata İnsan Kaynakları Müdürü, Genel Müdür, Şube Müdürü (şube alımı için) ya da Genel Müdürlük birim müdürleri (açılan mülakatlara göre) katılımlarıyla gerçekleşmektedir. Çeşitli sorular sorarak personele puanlar vermektedirler. Bankalarda çalışanlar 1.Derece Amirler/Yöneticiler, 2.Derece Amirler/Yöneticiler, 3.Derece Amirler/Yöneticiler ve 4.Derece Amirler/Yöneticiler üzerlerinden değerlendirme yapmaktadırlar. Amirler sıralaması en yakın hiyerarşik amir 1. Sicil amiri, bir sonraki 2. Sicil amiri şeklinde sıralanmakta olduğu saptanmıştır. Yani Bölüm Müdürü 1. Sicil Amiri, İnsan Kaynakları Müdürü 2. Sicil Amiri, Genel Müdür Yardımcısı 3. Sicil Amiri ve Genel Müdür 4. Sicil Amiri şeklindedir.

5.10 Değerlendirme Dönemi

Birinci değerlendirme amiri tarafından performans değerlendirme formunda doldurulması gereken ilk alan, değerlendirme dönemi alanıdır. ilgili alana değerlendirilmesi yapılan yılın tamamı (başlangıç ve bitiş tarihleri) yazılır. Değerlendirme tarihi alanına ise değerlendirme dönemi sonunda performans değerlendirmesinin son haline getirildiği tarih yazılır. Genellikle değerlendirme döneminin bitiminden sonraki ocak ayı içerisinde bir tarihtir. Göreve yeni başlama, tayin, terfi, isten ayrılma gibi

durumlarda ise, bu alanlara ilgili uygulama ilkeleri dikkate alınarak değerlendirilmesi yapılan görevde çalıştığı süre ve değerlendirmenin fiilen yapıldığı tarih yazılmalıdır.(örneğin bu değerlendirme 01.01.2017-31.12.2017 tarihlerini kapsar şeklinde ibare konulur.) (Cantekinler, 2007).

5.11 Performans Değerlendirme Süreci ve Form Doldurulması

Altta örneği verilen sicil değerlendirme formu işe başlayan yeni adayların 6 aylık deneme süresi boyunca performans değerlendirme amacı ile kullanılmaktadır. Bu değerlendirmeler yapıldıktan sonra personel ile de bu değerlendirmeler paylaşılmaktadır ki yanlış bir anlama yada farklı bir değerlendirme çıkarsa bunun sebepleri de konuşulmaktadır. Böylece personelde kendi için hem farkındalık hem de hataları varsa öğrenmiş olur ve herhangi bir durumda da kendisini insan kaynakları bölümü ile değerlendirmeler karşısında savunabilir.

| | | | |
|----------------------|--------------|-----------------------------|-------------------|
| Çalışanın Adı Soyadı | | İşe Giriş Tarihi | 01.01.2016 |
| Pozisyon/Ünvan | | Deneme Süresi Bitiş Tarihi: | 30.06.2016 |
| Bölüm : | Şubesi | | |

| DEĞERLENDİRME KRİTERLERİ | Performans Derecesi | | AÇIKLAMA |
|---------------------------------|----------------------|----------------------|----------|
| | 1.Yönetici | 2. Yönetici | |
| İş performansı | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| Takım çalışmasına uyum | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| İşine karşı ilgi ve sorumluluğu | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |

| | | | |
|--|----------------------|----------------------|--|
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| İletişim kabiliyeti | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| Müşteri odaklılık | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| Kendini geliştirme gayreti | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| Hal ve tavırlar | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| Dış görünüm ve giyim kurallarına uyum | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| Kendini ifade edebilme | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |

| DEĞERLENDİRME KRİTERLERİ | Performans Derecesi | | AÇIKLAMA |
|--------------------------|----------------------|----------------------|----------|
| | 1.Yönetici | 2. Yönetici | |
| İnisiyatif alma | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |
| İşe devamlılık-Dakiklik | Beklenenin Üstünde | Beklenenin Üstünde | |
| | Beklenenin Altında | Beklenenin Altında | |
| | Bekleneni Karşılıyor | Bekleneni Karşılıyor | |

5.12 Sicil Amirinin Sorumlulukları

Genel Müdür' e karşı sorumlu olup, sorumlu olduğu Şubede çalışan Müdür Yardımcısı ve Servis Yetkilisi çalışanların birinci derecede amiri olarak, bağlı personelinin ve bu personele bağlı bölümlerin operasyonel, mali, ticari, teknik ve idari faaliyetlerini zamanında, yönetmelik hükümlerine uygun yapmalarını sağlamak, denetlemek ve yönlendirmek. Banka hedef ve stratejileri doğrultusunda; Şubenin pazar payının büyütülmesi, karlılığın artırılması, maliyetlerin düşürülmesi gibi pazarlama ve operasyonel hedef ve stratejilerini belirlemek. Hedeflerle ilgili alınan/aldığı kararların sorumlularını belirleyip ilgili yöneticiler tarafından hedeflere ulaşılmasını sağlamak ve takibini yapmak. Bankanın yıllık İş Planı' na göre Şubedeki tüm birimlerin sorunsuz çalışmasını sağlamak adına yetki ve görevleri organize etmek, iş planı ve iş bölümü yapmak, iş planlarını periyodik olarak gözden geçirmek, gerekli gördüğü tedbirleri alarak uygulamak ve uygulatmak.

Şubenin Genel Müdürlük ve resmi kurum ve kuruluşlar ile koordinasyonunu sağlayarak iletişimin etkin bir şekilde yürütülmesini sağlamak. Şube içi operasyon ve satış birimleri arasındaki gerekli koordinasyonu, iletişimi ve ideal çalışma ortamını sağlamak.

Bankacılık mevzuatını ve banka yönetmeliklerini takip etmek, gerekli şube içi düzenlemeleri yapmak. Bankanın ürün ve hizmetlerinin geliştirilmesine yönelik öneriler sunmak, kampanya veya herhangi iş akışı ile ilgili yeni bir durumu Şube içinde uygulamaya koyup, uygulatmak.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Piyasa koşullarını sürekli olarak izlemek ve fırsatları araştırmak, bu konuda Bölge ve Genel Müdürlük birimlerine bilgi aktarımında bulunmak. Ekonomik gelişmeleri takip etmek ve gelişmelerin Şube portföyünde bulunan müşterilere yansımaları izlemek, gerekli önlemlerin alınmasını sağlamak. Rakip Bankaların ürün ve hizmetlerini incelemek, takip etmek bu konuda Genel Müdürlük ilgili bölümlerine bilgi aktarmak.

Belirlenen satış stratejileri, hedefler ve sektör bilgileri doğrultusunda müşteri portföyünün geliştirilmesi ve yeni müşteri kazanımı için; potansiyel müşteri listesi hazırlamak, müşteri ziyaretleri gerçekleştirmek, mevcut ve olası müşterileri banka ürünleri konusunda bilgilendirmek, değişik yatırım araçları konusunda alternatifler sunmak, müşterilerin banka ile çalışma biçimlerini incelemek, ihtiyaçlarını incelemek, kullanılmayan ürünler için çapraz satış olanaklarını müşterilere sunmak.

Şube müşterileri ile etkin sürdürülebilir ilişkiler içinde olmak, müşteri problemlerine en hızlı ve etkin şekilde çözüm üretmek, üretilmesini sağlamak. Pazarlama faaliyetleri kapsamında müşteri ziyaretlerinin programlı bir şekilde yürütülmesini ve ziyaretlerin müşteri takip sistemine girişini sağlamak/sağlatmak.

Riski azaltmak ve verimi arttırmak amacıyla kurumsal ve bireysel müşterilerin portföy yapısını, kullanılan fonların verimini, risk ve geri dönüşünü sürekli olarak denetlemek ve tedbir almak. İdari takipteki müşteriler ile ilgili gelişmeleri takip etmek, Genel Müdürlük birimlerini bilgilendirmek. Gerekliğinde Şubenin çalışma düzenini iyileştirmek, şube hizmetlerinin kalite ve verimliliğinin artırılması için öneriler geliştirmek, uygulanmasını sağlamak üzere harekete geçmek. Kendisine ve bağlı çalışanlarına tahsis edilmiş zaman, makine, teçhizat ve işyeri olanaklarının verimliliğini, güvenliğini ve kullanılabilir durumda olmasını sağlamak.

5.13 Performans Değerlendirme Görüşlerinin Belirtilmesi

Personelin güçlü yönleri, Gelişim alanları ve buna bağlı olan tüm özellikleri yazılı olarak aktarılmaktadır. Bu raporlar insan kaynakları tarafından değerlendirilerek gerekli tedbirler alınması koşulları ile ilgili birimlere iletilmektedir.

Tablo 3. Genel Düşünceler

| | | | |
|--|--|---|-------------------------------------|
| Personelin Güçlü Yönleri | | | |
| Personelin Gelişim Alanları | | | |
| Diğer Düşünceler | | | |
| DENEME SÜRESİ DEĞERLENDİRME SONUCU | | OLUMLU <input type="checkbox"/> | OLUMSUZ <input type="checkbox"/> |
| Değerlendiren | Yöneticinin | yazılı | görüşü: |
| | | | |
| İMZA | | | |
| 1.Yönetici (Adı Soyadı-Tarih-İmza) | 2.Yönetici (Adı Soyadı-Tarih-İmza) | İK Müdürü (Adı Soyadı-Tarih-İmza) | Genel Müdür |

6.SONUÇ VE ÖNERİLER

Bankacılık sektörü; mevcut yapısı, mevzuatı ve yasaları gereği çok denetimli ve organize olup takım çalışmasının önemli olduğu bir sektördür. Hal böyle iken sürekli gelişen bir yapı çerçevesinde mevcut risk yapılarının iyi şekilde yönetilmesi ve bunu sağlamak için gerekli olan kalifiyeli elemanlar sayesinde Bankacılık sektörü hedeflerine ulaşabilmektedir. Sürekli personel değişimi bankalar için maalesef hem zaman kaybı hem de maliyet olarak sıkıntı yaratmaktadır. Bankaların personel seçimleri için yapılan mülakat ve sınav süreçlerinde bankaya girişe hak kazanan personellerin skorlarının deneme

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

süreci sonunda daha da iyiye gittiği, bunun yanında az da olsa gerek görev ve şube yapıları bakımından personellerin işten durdurulması ve istifa etmeleri de söz konusu olmaktadır.

İşe girişte orta skor alan ve öne çıkan özellikleri bakımından da alınan personel kendini geliştirerek bankaya faydalı olmaktadır ve hatta üst yönetimin dikkatini çekerek daha sorumluluk gerektiren teknik birimlerde görevlendirilebilir.

Genel olarak iyi ve yüksek skor alan personeller yüksek oranda kendini geliştirerek performansını artırıyor yükseliyor ve bankaya faydalı bir personel oluyor.

Günümüzde Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti bankacılık sektöründe çalışan 3000 in üzerinde personel mevki gözetmeksizin bankanın performansı açısından büyük önem taşımaktadır. Mevcut rekabet koşulları ön planda tutulması, performans, müşteri memnuniyeti ve ürün geliştirme ve banka politikaları açısından personelin gücü bankaları zirveye taşımaktadır. Kendini geliştiremeyen personel kalifiye olmayan ve teknolojiyi kullanamayan personeller bankanın ilerlemesi bakımından faydalı olamamaktadır. Bu yüzden işe giriş skorları ve deneme süresindeki skorların iyi takip edilmesi ve gerekli özverilerin gösterilmesi bankaların menfaati için önemlidir.

Mevcut skorların yükselmesi için personelin sürekli eğitimi, teknolojiyi takip etmesi, müdür ve insan kaynaklarının eksik yönlerin tespit edilip onlar üzerinde çalışması gerekirse şube ve bölüm değişimi yapıp personeli motive etmesi, müşteri hedefleri doğrultusunda prim sistemi ve tatmin edici maaş verilmesi bunun yanında personellere ikinci bir şans da verilip onun üzerinde harcanan zaman ve maliyetlerin kaybının azalması konusunda da fayda sağlayacaktır.

Personel skorlarını ölçen yönetimin sağduyulu olması, objektif davranması ve skorları ilgili personele bildirip yanlış ve yanlış değerlendirilmesinin ortadan kaldırılmasına olanak sağlanmalıdır.

KAYNAKÇA

Arıçelik, G (2010). “Ticari Bankalarda Performans Ölçümü” İzmir

Armstrong, M. (2006). “A Handbook of Human Resource Management Practice”, LondonandPhiladelphia: KoganPage Limited

Armstrong (1996).”EmployeeReward. London: Institute of Personneland Development (IPD) House”.

Barutçugil, İ. (2002).Performans Yönetimi, Kariyer Yayıncılık iletişim Mart 2002 İstanbul s.183.

Bingöl, D. (2006). “İnsan Kaynakları Yönetimi, Arıkan Basım Yayımları Dağıtım Ltd. Şti., Denizli.

Bolton, T. (1997). “Human Resource Management: An introduction”. Massachusetts: BlackwellPublishers.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Cantekinler, M. (2007). "Bankacılık Sektöründe Performans Yönetimi ve Özel Bir Bankada Performans Yönetimine İlişkin Uygulama". Konya.
- Cusins P.(1997). "Orta Düzey Yöneticiler İçin Yönetim Teknikleri", Etkin Yönetim Dizisi Çeviri Günhan Günay Rota Yayınları 1.Basım İstanbul Ekim 1997 s. 68.
- Cummings, T.G. ve Worley, C.G (1997) "Organization Development and Change". United States of America. International Thompson Publishing.
- Çiftçi, M., & Öztürk, U. C. (2013). "Yetkinlik Bazlı Personel Seçme Faaliyetleri ve Türkiye'deki Büyük Ölçekli İşletmelerin İşgören Seçme Modeli Tercihlerindeki Eğilimler" . Türkiye: Sosyal ve Ekonomik Araştırmalar Dergisi.
- Çetin, C. (2013). "Toplam Kalite Yönetimi", İstanbul: Beta Basım A.Ş.
- Doğan, A. (2011). "Elektronik İnsan Kaynakları Yönetimi ve Fonksiyonları". Türkiye.
- Dokumacı, A. (2010). "İşe Alım Süreci Etkinliğinin Performans Değerlendirme Sistemi İle Ölçülmesi". Konya.
- Esen, S. (2007). "İnsan Kaynakları Yönetimi İşleyiş Biçimleri Değerlendirmesi : Avrupa ve Türkiye Uygulaması". Kahramanmaraş.
- Erel D. "Başarım Değerlendirmede Adalet ve İşgörenlerin Doyumu", Ankara Üniversitesi SBF Dergisi 52: 287-309, 1997.
- Fry, F.L., Stoner, C.R. ve Hattwick, R.E. (2004). "Business an Integrative Approach", New York: McGraw-Hill/Irwin
- İnalçık, H. (2014a). "Devlet-i 'Aliyye Osmanlı İmparatorluğu Üzerine Araştırmalar I", İstanbul: İş Bankası Kültür Yayınları.
- Jordan, K. (2009). Performans Değerlendirme Harvard Business School Press Pocket Mentor, Çev: Melis İnan, İstanbul: Optimist Yayınları.
- Karataş, A. (2013). "Bankacılık Sektöründe Cinsiyete Dayalı Kariyer Farklılaşması". Muğla: Organizasyon ve Yönetim Bilimleri Dergisi.
- Keçecioglu, T., & Yılmaz, M. K. (2012). "İnsan Kaynaklarının Bakış Açısının Saptanmasına Yönelik Bir Araştırma". Balıkesir.
- Koçak, O., & Erdoğan, Z. B. (2011). "Bankacılık Sektöründe Yeni İnsan Kaynakları Yönetimi Yaklaşımları Hakkında Bir Uygulama". Türkiye: Sosyal Siyaset Konferansları, Sayı: 60, 2011/1, s. 259-283.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Koyuncu, Ö., & Özcan, M. (2014). "Personel Seçim Sürecinde Analitik Hiyerarşi Süreci ve Topsis Yöntemlerinin Karşılaştırılması (Otomotiv Sektörü)" . Ankara : H.Ü. İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, Cilt 32, Sayı 2, 2014, 195-218.

Mayatürk Akyol, E. (2011). "Yetkinliğe Dayalı Performans Yönetimi", Ankara: Nobel Akademik Yayıncılık Ltd. Şti.

Murphy, K.R. ve Cleveland, J.N. (1995). "Understanding Performance Appraisal: Social, Organizational and Goal Based Perspectives", California: Sage Publications.

Özcan, Ö. K.-M. (2014). Personel Seçim Sürecinde Analitik Hiyerarşi Süreci . Ankara.

Özgörmüş, E., Mutlu, Ö., & Güner, H. (2005). "Bulanık AHP ile Personel Seçimi". İstanbul: V. Ulusal Üretim Araştırmaları Sempozyumu.

Özkasap, Ş. (2013). "Bankalarda Uygulanan İşe Alıştırma Eğitim Programlarının İşgören Performansı Üzerine Etkisi (Bankacılık Sektöründe Bir Araştırma)". Balıkesir.

Öztürk, Ü. (2010). "Performans Yönetimi", İstanbul: Alfa Basım Yayım Dağıtım Ltd. Şti.

"Performans Değerlendirme ve Süreç Yönetim Aracı". (2010). Atatürk Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, Cilt: 24, Sayı: 3, 2010 1.

Pugh, D.(1991). "Organizational Behaviour". Prentice Hall International (UK) Ltd

Sabuncuoğlu, Z. ve Tokol, T. (2013). İşletme, İstanbul: Beta Basım A.Ş

Sarılar, Ö. (2006). "Bankalarda Uygulanan İşe Alım Süreçleri: Türkiye Cumhuriyeti Merkez Bankası Örneği". Ankara.

Schuler, R. S. (1995). "Managing Human Resources", USA: West Publishing Company.

Sikyr, M. (2013). "Best Practices in Human Resource Management: The Source of Excellent Performance and Sustained Competitiveness", Central European Business Review, C.2 S.1, s.43-48.

Torrington, D. ve Hall, L. (1995) "Personel Management". HRM in Action.

Waxin, M. F. ve Bateman, R. (2009) "Public Sector Human Resource Management Reform Across Countries: From Performance Appraisal to Performance Steering?", European J. International Management, 3 (4): 495-511

Uyargil, C. (2013) "Performans Yönetimi Sistemi Bireysel Performansın Planlanması Değerlendirilmesi ve Geliştirilmesi", İstanbul: Beta Basım A.Ş.

ÖRGÜTSEL ADALET İLE İLGİLİ YAZILMIŞ TEZLERİN BİBLİYOMETRİK ANALİZİ

Doç.Dr. Burcu ÖKSÜZ*

Yeliz YAPICIOĞLU AYAZ^{35}**

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, örgütsel adalet konusunda yazılmış yüksek lisans ve doktora tezlerini bibliyometrik analiz ile değerlendirmektir. Araştırmada, 2000-2018 yıllarında yazılmış 366 tez incelenmiştir. 366 tezin %83,06'sı yüksek lisans, %16,93'ü ise doktora tezidir. Tezlerin %93'ü Türkçe, %16,93 ise İngilizce yazılmıştır. Yıllar bazında tez adetleri incelendiğinde, en fazla tezin 2017 yılında (53 tez) yazılmış olduğu görülmüştür. Tezlere, 21 Ekim-24 Ekim 2018 tarihlerinde www.tez.yok.gov.tr sayfası aracılığıyla erişim sağlanmıştır. Örgütsel adalet alanında yazılmış yüksek lisans ve doktora tezleri; 'Tez izin durumu', 'Tez dili', 'Tez yazar cinsiyetleri', 'Tez yayınlanan üniversite', 'Tez yayınlanan program', 'Tezlerin üzerinde durduğu konu', 'Tezlerin yayınlandıkları yıllar', 'Tez yazar cinsiyetleri', 'Tez danışman unvanları', 'Tez sayfa sayıları', 'Tezlerde kullanılan araştırma yöntemleri' olarak belirlenen kategoriler çerçevesinde incelenmiş ve tezlerin Türkiye'deki genel durumu ortaya koyulmuştur.

Anahtar kelimeler: Örgütsel Adalet, Lisansüstü Tezler, Bibliyometrik Analiz, Kategoriler

ABSTRACT

The purpose of this study evaluate master and doctorate thesis about organizational justice with bibliometric analysis. 366 thesis were examined between 2000 to 2018 in this study. 83,06% (304 thesis) are master thesis, and 16,93% (62 thesis) are doctorate thesis. 93% (341 thesis) were Turkish, and 16,93% (62 thesis) were written an English language. Thesis were published mostly in 2017 and thesis numbers were 53. Thesis were reached through www.tez.yok.gov.tr between 21th to 24th of October. Master and doctorate thesis on organizational justice were categorized according to 'Permission Status of Thesis', 'Thesis language', 'Thesis writer gender', 'Thesis published university', 'Thesis published programme', 'Thesis contents', 'Published years of thesis', 'Thesis advisors',

* İzmir Kâtip Çelebi Üniversitesi, Medya ve İletişim Bölümü, Halkla İlişkiler ve Reklamcılık Anabilim Dalı, İzmir, burcu.oksuz@ikc.edu.tr

** Ege Üniversitesi İletişim Fakültesi, Genel Reklamcılık Anabilim Dalı, İzmir, yeliz.yapicioglu@gmail.com

'Thesis page numbers', 'Thesis used research method'. Topics of thesis aim to reveal general situation on thesis about organizational justice in Turkey within the scope of identifying categories.

Key words: *Organizational justice, graduate thesis, bibliometric analysis, categories*

1. GİRİŞ

Örgütlerle ilgili yazılan birçok çalışmanın örgütlerde öz değerlerin önemine odaklandığı görülmektedir. Adalet, bu öz değerlerden biri olarak tanımlanır (Konovsky, 2000: 490). Fortin ve Fellenz (2008: 416) örgütlerde adaletin ya da adaletsizliğin yayılmasının büyük ölçüde kara kutu olduğunu ileri sürmektedir. Adillik algılarını oluşturan pek çok potansiyel yol bulunur. Yöneticilerin genellikle adil olarak algılanan kriterleri içeren prosedürleri izlemesi, dağıtım kararlarını ve bilgilendirme politikasının temelini değiştirmesi veya çalışanlar için adil norm seçimlerinin esaslarını etkilemeye çalışması bunlara örnek olarak gösterilebilir (2008: 416). Örgütsel adalet örgütlerin içinde çokça tartışılan bir konu olmasının yanında, akademi de üzerinde giderek daha fazla çalışılan bir alan olarak dikkat çekmektedir. Bu çalışmanın amacı son zamanlarda çeşitli araştırmalara konu olan örgütsel adalet ile ilgili yazılan tezlere yönelik bir durum tespiti yapmaktır.

2. TEORİK ÇERÇEVE

2.1. Örgütsel Adalet Kavramı ve Önemi

John Rawls (1999: 3) adaleti, “sosyal örgütlerin birinci erdemi” olarak görür. İlk kez Greenberg tarafından 1987 yılında kullanılan örgütsel adalet kavramı, “örgütlerdeki hakkaniyete ilişkin çalışan algılarını” açıklamaktadır (Beugre, 2007; Beugre, 1998). Doğrudan işyerindeki adaleti tanımlayan bir kavram olarak kullanılan örgütsel adalet (Moorman, 1991), neticelerin nasıl dağıtılacağı (ödül ve cezalar gibi), bu dağıtım kararlarında prosedürlerin nasıl kullanılacağı (bunun yanında diğer karar türlerinde) ve kişilerarası ilişkilerde insanların nasıl davranacağı konularını yönlendiren kurallar ve sosyal normlarla ilgilidir (Folger ve Cropanzano, 1998: xiii).

Beugre (1998: xiii) örgütsel adaleti “Kişilerin yöneticileri, astları, eş düzeydeki çalışma arkadaşları ve sosyal bir sistem olarak örgütle ilişkilerinde, sosyal ya da ekonomik olarak örgüt içinde gerçekleşen mübadeleye ilişkin adillik algısı” olarak tanımlamaktadır. Para veya statü gibi bir grup veya kişiye tahsis edilmiş bir kazanım, adilliği açısından yargılanabilir. İnsanlar bağlılıkla hareket ettiklerinden, adalet kişilerarası ilişkilerin ve grup süreçlerinin anlaşılmasında oldukça önemlidir (Folger ve Cropanzano, 1998: xxi). Örgüt içinde adil davranıldığını düşünen çalışanlar yaptıkları çalışmaların karşılığını alacaklarını düşünerek daha büyük istekle çalışmakta ve örgütsel amaçları kendi amaçlarıymış gibi benimseyebilmektedir. Bundan dolayı örgütlerin tüm birimlere yayılan bir adalet

anlayışı ile hareket etmesi ve çalışanların adil olmadığını düşündükleri konularda nesnel değerlendirmeleri çalışanlara açıklayabilmesi ve varsa adaletsizlikleri gidermesi beklenmektedir. Böyle bir anlayışla hareket eden örgütlerin çalışanların mutlu olacakları bir ortam yaratması ve bunun bir sonucu olarak hem çalışan verimliliğini hem de örgütsel verimliliği artırması olasıdır.

Yapılan araştırmalarda, örgütsel adaletin iş stresi (Lambert vd., 2007), örgütsel bağlılık (Yazıcıoğlu ve Topaloğlu, 2010; Klendauer ve Deler, 2009; Lambert vd., 2007; Moorman vd., 1993; McFarlin ve Sweeney, 1992), iş memnuniyeti (Özer ve Günlük, 2010; Lambert vd., 2007; Mossholder vd., 1998; McFarlin ve Sweeney, 1992; Alexander ve Ruderman, 1987), örgütsel vatandaşlık (Konovsky ve Pugh, 1994; Moorman vd., 1993), örgütsel özdeşleşme (Olkkonen ve Lipponen, 2006), ücret tatmini (McFarlin ve Sweeney, 1992), çalışan sağlığı (Elovainio vd., 2002), liderlik (Arslantaş ve Pekdemir, 2007) ve işten ayrılma niyeti (Özer ve Günlük, 2010) gibi birçok kavramla ilişkisi incelenmiştir.

McFarlin ve Sweeney (1992) tarafından yapılan araştırmada, dağıtımsal adaletin ücret ve iş tatmini gibi kişisel sonuçlarda işlemsel adalete nazaran daha önemli olduğu; buna karşılık örgütsel bağlılık ve astın yöneticisini değerlendirmesi gibi örgütsel sonuçlarda işlemsel adaletin dağıtımsal adalete göre daha önemli olduğu; ancak işlemsel adalet ve dağıtımsal adalet örgütsel sonuçlar açısından etkileşim halinde bulunduğu sonucuna ulaşılmıştır. Smither ve diğerleri (1993) araştırmalarında örgütsel adalet algısının, kurumun işveren olarak diğerlerine önerilmesiyle ilişkili olduğu bulgusunu elde etmişlerdir. Moorman ve diğerleri (1993) tarafından ulusal bir televizyon işletmesinde yapılan araştırmada, işlemsel adalet ile bağlılık, tatmin ve örgütsel vatandaşlık davranışı arasında bir ilişki olduğu saptanmıştır. Tutar (2007) tarafından yapılan araştırmada, örgütsel işlem adaletinin iş tatminine, iş tatmininin de duygusal bağlılığa katkı sağladığı saptanmıştır. Konovsky ve Pugh (1994) tarafından 475 hastane çalışanı ve yöneticileri ile yapılan araştırmada, örgütsel adalet ile örgütsel vatandaşlık davranışı arasındaki ilişkide yöneticiye güvenin aracı bir role sahip olduğu belirlenmiştir. Olkkonen ve Lipponen (2006) tarafından bir araştırma kurumunun çalışanlarına yönelik yürütülen çalışmada, örgüt odaklı işlemsel ve dağıtımsal adaletin örgütsel özdeşleşme ile; buna karşılık yönetici odaklı etkileşimsel adaletin iş-birim özdeşleşmesi ile olumlu yönde ilişkili olduğu saptanmıştır.

Beugre ve Baron (2001) tarafından yapılan araştırmada, çalışanların örgütlerindeki işlemsel adalet ile etkileşimsel adalete ilişkin algılarının sistematik adalet (örgütün bir bütün olarak adil olması) algılarının olumlu yönde öngörücüsü olduğu saptanmıştır. Buna karşılık dağıtımsal adalet algılarının, sistematik adalet algılarının öngörücüsü olmadığı sonucuna ulaşılmıştır. Arslantaş ve Pekdemir (2007) tarafından yapılan araştırmada, yöneticilerin dönüşümcü liderlik davranışlarıyla çalışanların örgütsel adalet algıları arasında ve çalışanların örgütsel adalet algıları ile örgütsel vatandaşlık davranışları arasında anlamlı bir ilişki olduğu belirlenmiştir. Williams ve diğerleri (2002) yaptıkları araştırmada, yöneticilerinin çalışanların tatil zamanı, hastalık izni gibi faydalara erişimine ilişkin karar verme süreçlerini daha adil olarak algılayan çalışanların, süreçleri daha az adil olarak algılayanlara göre hem

kazanç sistemlerinden hem de kazanç düzeylerinden daha fazla memnuniyet duydukları sonucuna ulaşmışlardır. Elovainio ve diğerleri (2002) yaptıkları araştırmada, örgütsel adalet düzeyinin düşük olmasının çalışan sağlığı açısından risk olduğunu ileri sürmüşlerdir.

2.2. ÖRGÜTSEL ADALET TÜRLERİ

2.2.1. Dağıtımsal Adalet

Dağıtımsal adalet, Adams'ın Eşitlik Teorisine (1963,1965) dayanmaktadır (Cohen-Charash ve Spector, 2001; DeConinck ve Stilwell, 2004: 226). Bu teori, diğerleriyle karşılaştırıldığında çalışanların kendisine nasıl davranıldığına ilişkin inançlarına vurgu yapar. Eşitlik teorisine göre, çalışanlar işlerine eğitim, çaba ve deneyim gibi girdileri katmakta; bunun sonucu olarak da ücret ve terfi gibi çıktılar elde etmektedirler. Çalışanların işlerinden elde ettikleri ile işlerine kattıkları arasındaki karşılaştırma sonucunda algıladıkları oran, eşitliğin ya da eşitsizliğin belirlenmesine yardım etmektedir. Diğer bir deyişle, çalışanlar katkıları doğrultusunda bazı kazanımlar beklerler (DeConinck ve Stilwell, 2004: 226). Bu teoriye göre çalışanlar, yaptıkları karşılaştırmalara dayanarak kazanımların adil olup olmadığını değerlendirirler. Örneğin, bir çalışan diğer bir çalışanla aynı oranda çaba gösteriyor ancak diğer çalışan daha fazla kazanım elde ediyorsa (daha yüksek ücret, daha fazla promosyon gibi) kazanımların adil olmadığı şeklinde bir yargıya ulaşabilir (Cropanzano vd., 2001: 167; Scandura, 1999: 28).

Dağıtımsal adalet, elde edilen kazanımlarda ya da dağıtımlarda algılanan adilliktir (Cohen-Charash ve Spector, 2001; Folger ve Cropanzano, 1998; Sheppard vd., 1992) ve dağıtım konusunda kazanımların örtülü normlarla tutarlılığına ilişkin algıları ifade etmektedir (Klendauer ve Deler, 2009: 31). Dağıtım adaletine ilişkin değerlendirme yaparken kişiler, kazanımların adil olup olmadığı ve etik kurallara uygunluğu ile yargılarda bulunurlar. Objektif bir doğruluk standardının nadiren bulunması nedeniyle, değerlendirmeler yanıltıcı olabilir. Adillığe ilişkin kararlarda, kıyaslamalardan ve referans modellerden yararlanılmaktadır. Örneğin, bir çalışan maaşının adillğine karar verebilmek için aynı işi yapan başka kişilerin maaşları ile karşılaştırmalar yapmaktadır (Folger ve Cropanzano, 1998). Altıntaş'a göre (2006: 23) "bireyler, dağıtım adaletine ilişkin değerlendirmelerinde aldıkları kazanımların yanı sıra bu kazanımların kendi standartlarını karşılayıp karşılamadığını da dikkate alırlar". Dağıtımsal adaletin mantığı anlaşılır olmasıdır. Kişinin memnuniyeti, çekişmelerin çözümünde adil ve iyi niyetli hareket edildiğinde artar (Nabatchi vd, 2007: 150).

2.2.2. İşlemsel Adalet

İlgili yazında prosedürel adalet olarak da tanımlanan işlemsel adalet, genel olarak dağıtım kararlarının nasıl alındığını, bu kararların alınışındaki nesnel ve öznel durumları ifade etmekte (Konovsky, 2000: 492) ve örgütün kişilerin edineceği faydaları belirlerken takip ettiği prosedürlere ilişkin çalışan algıları olarak tanımlanmaktadır (Scandura, 1999: 28). Diğer bir deyişle, kazanımların

belirlendiği süreçlerin adil olup olmadığına ilişkin algılardır (Klendaueer ve Deler, 2009: 31). Sheppard ve diğerleri (1992) işlemsel adaletin prosedür ve süreçlerle ilgili yargılara dayandığını ve dolayısıyla çalışanların bu süreçlerin nasıl işlediği ile ilgili değerlendirmelerinin adalet algısını belirlediğini vurgularlar.

İşlemsel adalet, “Örgütte herkese yönelik olarak aynı prosedürün izlenmesi, işgörenlerin kararlara katılma imkânının olması ve bilgilendirme sisteminin olmasıdır” (Yavuz, 2010: 306). Brashear ve diğerleri (2004: 87) tarafından belirtildiği gibi, prosedürler ve politikalar açısından adaletin temeli, prosedürlerin süreç ve uygulamadaki adilliyidir. Eğer değerlendirme adilse, kişiler sonuçları kendileri açısından olumsuz olsa da kabul konusunda isteklidirler (Tyler ve Lind, 1992). Nabatchi ve diğerlerine göre (2007: 151) örgütsel süreçler ve prosedürler adil olarak algılanırsa, kişiler daha fazla memnuniyet duyar, prosedürlerin sonucunu kabul etmeye daha istekli olur ve örgüt hakkında daha fazla olumlu tutumlara sahip olur. Sweeney ve Mcfarlin’a göre (1997: 83) araştırmalar, dağıtılanların kendisinin adilliyinin ötesinde ve üstünde, kazanımların dağıtım süreçlerinin önemini altını çizmektedir.

Leventhal (1980) işlemsel adalet kapsamında örgütlerin adil olarak görülmelerini sağlayan altı kuralı, “tutarlılık, önyargıyı durdurma, doğruluk, adil olmayan kararların değiştirilmesi, temsilcilik ve etik” şeklinde sıralamaktadır. Örgütsel prosedürler, örgütün kaynaklarını dağıtım yolunu temsil eder. Bu gerçek, işlemsel adaletin örgütsel bağlılık gibi, örgüte yönelik bilişsel, duygusal ve davranışsal tepkilerle ilgili olmasının bir nedeni olarak görülmektedir (Cohen-Charash ve Spector, 2001: 281). “Çalışanların örgütsel amaçlara göre davranmaları ve işlerinden tatmin bulup örgütsel hedeflere bağlanabilmeleri, söz konusu eylem ve işlemleri işlem adaletine uygun olarak değerlendirmelerine bağlıdır” (Tutar, 2007: 101).

2.2.3. Etkileşimsel Adalet

Etkileşimsel adalet, örgütsel prosedürlerin uygulanma sürecinde, kişilerarası davranışların niteliğine vurgu yapmaktadır (Bies ve Moag, 1986). Etkileşimsel adalet, örgütsel uygulamaların insanî yönüyle alakalıdır ve yönetimin (veya ödülleri ve kaynakları kontrol edenlerin) adaletin alıcısı konumundaki kişilere yönelik davranış yoludur (Cohen-Charash ve Spector, 2001: 281). Nabatchi ve diğerleri (2007: 151) etkileşimsel adaletin, etkileşimin prosedürel olmayan yönlerinin adilliyini yansıttığını vurgular.

Örgütsel adaletin yöneticiler tarafından takipçilere iletilmesini kapsayan etkileşimsel adalet (Scandura, 1999: 28), örgütsel uygulamaların kişilerarası yönlerine odaklanmaktadır (Cohen-Charash ve Spector, 2001: 279). Etkileşimsel adalet kapsamında yöneticilerin nasıl davrandığı ve neler söylediği gibi pek çok faktör, çalışanların adalet algıları üzerinde etkili olmaktadır. Dolayısıyla etkileşimsel adalet, kişilerarası davranışların kalitesine de vurgu yapar. Bazı davranışlar adil, bazıları ise adil olmayan şekilde değerlendirilebilir (Folger ve Cropanzano, 1998). McDowall ve Fletcher (2004: 10)

etkileşimsel adaletin, örgütsel prosedürlerle ilgili olarak açısından kişilerarası iletişimdeki algılanan adillik olduğunu belirtir. Etkileşimsel adalet, iki spesifik kişilerarası davranış türünden oluşmaktadır. Kişilerarası adalet olarak adlandırılan birinci tür, prosedürlerin uygulanmasında ve çıktıların belirlenmesinde yetkililerin veya üçüncü kişilerin nazik, ağırbaşlı ve saygılı davranma düzeylerini yansıtmaktadır. İkincisi, bilgisel adalet olarak adlandırılmakta ve prosedürlerin neden o şekilde uygulandığı veya çıktıların neden o şekilde dağıtıldığı hakkında insanlara bilgi sağlayan açıklamalara odaklanmaktadır (Colquitt vd., 1986: 427; Greenberg, 1993: 84-85). Benzer şekilde Folger ve Cropanzano (1998) etkileşimsel adaletin kişilerarası duyarlılık ile açıklamalar ve sosyal sorumluluktan oluşan iki alt bölüme sahip olduğunu altını çizmektedir.

Duyarlılık olumsuz bir sonuca ilişkin insanların daha iyi hissetmelerini sağlayabildiğinden, etkileşimsel adalet deneyimi, kazanımlara ilişkin kararlara yönelik reaksiyonları değiştirebilmektedir (Nabatchi vd, 2007: 151). Bir çalışan etkileşimsel adaletsizlik hissettiğinde, işlemsel adalette beklendiği gibi bir bütün olarak örgüte veya dağıtımsal adalette beklendiği gibi belirli bir sonuca karşı olumsuz reaksiyon göstermesi yerine yöneticisine (veya bu kişiye etkileşimsel olarak adil davranmayan varlığa) karşı olumsuz tepkiler vermesi beklenir. Bundan dolayı çalışanın örgütün bütününden ziyade doğrudan yöneticisine karşı memnuniyetsizlik göstermesi beklenir (Cohen-Charash ve Spector, 2001: 281).

3. ARAŞTIRMA

3.1 Araştırma Amacı ve Soruları

Çalışmanın amacı, Türkiye’de örgütsel adalet konusunda yazılmış lisansüstü tezlerin genel durumunu bibliyometrik analizle ortaya koymaktır.

Araştırma kapsamında aşağıdaki soruların yanıtları aranmaktadır:

1. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili yazılan tezler hangi dillerde yazılmıştır?
2. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili yazılan tezlerde izin oranları nedir?
3. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili yazılan tezler kaç sayfadır?
4. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili yazılan tez yazarlarının cinsiyet dağılımı nasıldır?
5. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili yazılan tez danışmanlarının unvanlarının yüzdeliği nedir?
6. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili yazılan tezler üniversitelerin hangi programlarında yazılmıştır?
7. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili yazılan tezlerin en çok en çok hangi yıllarda yayınlanmıştır?

8. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili tezler üniversitelerde hangi oranda yazılmıştır?

9. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili tezlerde ağırlıklı olarak hangi konular üzerinde durulmuştur?

10. Ulusal tez merkezinde sosyal medya ile ilgili tezlerde kullanılan veri toplama araçları/teknikleri nelerdir?

3.2 Araştırma Sınırlılığı

Araştırmanın içeriğini www.tez.yok.gov.tr sayfasında örgütsel adalet anahtar kelimesi yazılarak ulaşılan 318 izinli lisansüstü tez oluşturmaktadır.

3.3 Araştırma Yöntemi

Çalışmada, nitel araştırma yöntemlerinden bibliyometrik analiz tekniği kullanılmıştır. Bibliyometrik analiz; bilimsel araştırmaların gelişim düzeyini artırma noktasında daha geniş bir perspektiften bakmaya olanak sağlayan, disiplinler arası temel bir dayanak olarak kabul edilmektedir (Samiee ve Chabowski, 2012: 369). Analiz, 21 Ekim-28 Kasım 2018 tarihlerinde her iki araştırmacı tarafından yapılmıştır.

4. BULGULAR

Araştırmada analiz edilen tezlerin türlerine ilişkin dağılıma aşağıda tabloda yer verilmiştir.

Tablo 1. Tez Türü

| Tez Türü | Adet | Yüzdeler |
|---------------|------|----------|
| Yüksek lisans | 266 | %83,64 |
| Doktora | 52 | %16,35 |
| Toplam | 318 | %99,99 |

Örgütsel adalet alanında www.yok.gov.tr sayfasında toplamda 368 adet teze ulaşılmıştır. Bu tezlerden 50'sinin izinsiz olduğu görülmüştür. Bu doğrultuda 318 adet izinli yüksek lisans ve doktora tezine yönelik analiz yapılmıştır. İzinli tezlerin %83,64'ünün (266 tez) yüksek lisans, %16,35'inin (52 tez) doktora tezlerinden meydana geldiği görülmüştür.

Tablo 2. Tez İzin Durumu

| İzin Durumu | Yüksek lisans | | Doktora | |
|-------------|---------------|--------|---------|--------|
| İzinli | 266 | %86,64 | 52 | %83,87 |
| İzinsiz | 40 | %13,07 | 10 | %16,12 |
| Toplam | 306 | %99,71 | 62 | %99,99 |

Örgütsel adalet alanında yazılan 306 adet yüksek lisans tezinin %86,64'sinin (266 adet) izinli, %13,07'sinin ise (40 adet) izinsiz olduğu; yayınlanan 62 adet doktora tezinin %83,87'sinin (52 adet) izinli, %16,12'sinin (10 adet) izinsiz olduğu görülmektedir.

Tablo 3. Tez Dili

| | Yüksek lisans | | Doktora | |
|-----------|---------------|--------|---------|--------|
| Türkçe | 245 | %92,10 | 50 | %96,15 |
| İngilizce | 21 | %7,89 | 2 | %3,84 |
| Toplam | 266 | %99,99 | 52 | %99,99 |

Örgütsel adalet konusunda yazılan yüksek lisans tezlerinin %92,10'unun (245 adet) Türkçe, %7,89'unun (21 adet) İngilizce; doktora tezlerinin ise %96,15'inin (50 adet) Türkçe, %3,84'ünün (2 adet) İngilizce olduğu görülmüştür.

Tablo 4. Tez Yazar Cinsiyetleri

| Cinsiyet | Yüksek lisans | | Doktora | |
|----------|---------------|--------|---------|--------|
| Kadın | 157 | %59,02 | 19 | %36,53 |
| Erkek | 109 | %40,97 | 33 | %63,46 |
| Toplam | 266 | %99,99 | 52 | %99,99 |

Tez yazarlarının cinsiyetleri incelendiğinde 266 adet yüksek lisans tezinin %59,02'sinin (157 kişi) kadınlar, %40,97'sinin (109 kişi) erkekler tarafından yazıldığı; 52 adet doktora tezinin %36,53'ünün (19 kişi) kadınlar, %63,46'sının (33 kişi) erkekler tarafından yazıldığı görülmektedir.

Tablo 5. Tezin Yayınlandığı Yıl Aralığı

| Yıl | Yüksek Lisans | | Doktora | |
|------|---------------|--------|---------|--------|
| 2018 | 22 | %8,27 | 6 | %11,53 |
| 2017 | 28 | %10,52 | - | - |
| 2016 | 23 | %8,64 | 4 | %7,69 |
| 2015 | 42 | %15,78 | 3 | %5,76 |
| 2014 | 40 | %15,03 | 11 | %21,15 |
| 2013 | 27 | %10,15 | 6 | %11,53 |
| 2012 | 11 | %4,13 | 4 | %7,69 |
| 2011 | 21 | %7,89 | 1 | %1,92 |
| 2010 | 25 | %9,39 | 5 | %9,61 |

| | | | | |
|--------|-----|--------|----|--------|
| 2009 | 10 | %3,75 | 5 | %9,61 |
| 2008 | 5 | %1,87 | 1 | %1,92 |
| 2007 | 4 | %1,50 | 4 | %7,69 |
| 2006 | 4 | %1,50 | - | - |
| 2005 | 2 | %0,75 | 1 | %1,92 |
| 2004 | 2 | %0,75 | 1 | %1,92 |
| Toplam | 266 | %99,92 | 52 | %99,94 |

Örgütsel adalet konusundaki ilk tezin 2004 yılında yazıldığı görülmüştür. Yüksek lisans tezleri %15,78 oranla (42 tez) 2015, %15,03 oranla (40 tez) 2014 yılında, %10,52 oranla (28 tez) 2017 yılında; doktora tezleri ise %21,15 oranla (11 tez) 2014 yılında, %11,53 oranla (6 tez) 2013 yılında, %11,53 oranla (6 tez) 2018 yılında yazılmıştır.

Tablo 6. Tez Danışmanlarının Unvanları

| Unvan | Yüksek lisans | | Doktora | |
|--------------|---------------|--------|---------|--------|
| Prof.Dr. | 70 | %26,31 | 29 | %55,76 |
| Doç.Dr | 93 | %34,96 | 18 | %34,61 |
| Dr.Öğr.Üyesi | 99 | %37,21 | 5 | %9,61 |
| Dr | 4 | %1,50 | - | - |
| Toplam | 266 | %99,98 | 52 | %99,98 |

Örgütsel adalet konusunda yazılan yüksek lisans tezlerinin danışmanlığında %37,21 oranla (99 kişi) Doktor öğretim üyelerinin birinci sırada olduğu, bu oranı %34,96 oranla (93 kişi) Doçent unvanına sahip öğretim üyelerinin takip ettiği; doktora tezlerinde ise %55,76 oranla (29 kişi) Profesör unvanına sahip öğretim üyelerinin danışmanlıkta birinci sırada olduğu ve bu oranı %34,18 (18 kişi) ile Doçent unvanına sahip öğretim üyelerinin takip ettiği görülmektedir.

Tablo 7. Tez Sayfa Aralıkları

| | Yüksek lisans | Yüzde | Doktora | Yüzde |
|----------|---------------|--------|---------|--------|
| 50-100 | 40 | %15,03 | 1 | %1,92 |
| 101-150 | 178 | %66,91 | 1 | %1,92 |
| 151-200 | 39 | %14,66 | 25 | %48,07 |
| 201-250 | 8 | %3,00 | 17 | %32,69 |
| 251-300 | - | - | 6 | %11,53 |
| 301-350 | 1 | %0,37 | 1 | %1,92 |
| 351 -400 | - | - | 1 | %1,92 |
| Toplam | 266 | %99,97 | 52 | %99,97 |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Yüksek lisans tez sayfa sayılarının en fazla %66,91 oranla (178 tez) 101-150 sayfa aralığında olduğu, Doktora tezlerinin ise %48,07 oranla (25 tez) 151-200 sayfa aralığında olduğu görülmüştür.

Tablo 8. Tezin Yayınlandığı Üniversiteler

| Üniversiteler | Yüksek lisans | Yüzde | Doktora | Yüzde |
|------------------------|---------------|-------|---------|-------|
| Marmara | 18 | %6,76 | 5 | %9,61 |
| Gazi | 13 | %4,88 | 5 | %9,61 |
| Bahçeşehir | 14 | %5,26 | - | - |
| Türk Hava Kurumu | 9 | %3,38 | - | - |
| Yıldız Teknik | 9 | %3,38 | - | - |
| Sakarya Üniversitesi | 6 | %2,25 | 2 | %3,84 |
| İstanbul | - | - | 3 | %5,76 |
| Atatürk Üniversitesi | 4 | %1,50 | 5 | %9,61 |
| Sakarya Üniversitesi | 8 | %3,00 | - | - |
| Dumlupınar | 6 | %2,25 | 1 | %1,92 |
| Balıkesir | 6 | %2,25 | 1 | %1,92 |
| Uşak | 6 | %2,25 | - | - |
| Pamukkale Üniversitesi | 6 | %2,25 | - | - |
| Haliç | 5 | %1,87 | 1 | %1,92 |
| Selçuk | 4 | %1,50 | 2 | %3,84 |
| Yeditepe | 5 | %1,87 | 1 | %1,92 |
| Beykent | 5 | %1,87 | 1 | %1,92 |
| Süleyman Demirel | 3 | %1,12 | 3 | %5,76 |
| Hacettepe Üniversitesi | 5 | %1,87 | 1 | %1,92 |
| Zirve Üniversitesi | 6 | %2,25 | - | - |
| Fırat | 5 | %1,87 | - | - |
| İnönü | 3 | %1,12 | 2 | %3,84 |
| Ankara Üniversitesi | 1 | %0,37 | 4 | %7,69 |
| Afyon Kocatepe | 5 | %1,87 | - | - |
| Kara Harp Okulu | 4 | %1,50 | 1 | %1,92 |
| Gebze Yüksek teknoloji | 3 | %1,12 | 2 | %3,84 |
| Ortadoğu Teknik | 5 | %1,87 | - | - |
| Muğla Sıtkı Koçman | 2 | %0,75 | 2 | %3,84 |
| Mevlana | 4 | %1,50 | - | - |
| Dokuz Eylül | 3 | %1,12 | 1 | %1,92 |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | | | |
|--------------------------|---|-------|---|-------|
| Eskişehir Osmangazi | 4 | %1,50 | - | - |
| Mehmet Akif Ersoy | 4 | %1,50 | - | - |
| Gaziosmanpaşa | 3 | %1,12 | - | - |
| Kocaeli | 2 | %0,75 | 1 | %1,92 |
| Çanakkale Onsekiz Mart | 2 | %0,75 | 1 | %1,92 |
| Okan Üniversitesi | 3 | %1,12 | - | - |
| Nevşehir | 3 | %1,12 | - | - |
| Maltepe | 3 | %1,12 | - | - |
| İstanbul Arel | 3 | %1,12 | - | - |
| İstanbul Aydın | 3 | %1,12 | - | - |
| Erciyes | 2 | %0,75 | 1 | %1,92 |
| Abant İzzet Baysal | 3 | %1,12 | - | - |
| Kahramanmaraş Sütçü İmam | 2 | %0,75 | 1 | %1,92 |
| Trakya | 3 | %1,12 | - | - |
| Akdeniz | 3 | %1,12 | - | - |
| Adnan Menderes | 1 | %0,37 | 1 | %1,92 |
| Atılım | 2 | %0,75 | - | - |
| Çukurova | - | - | 2 | %3,84 |
| Yakın Doğu Üniversitesi | 2 | %0,75 | - | - |
| İstanbul Sabahattin Zaim | 2 | %0,75 | - | - |
| Harran Üniversitesi | 2 | %0,75 | - | - |
| Mersin | 1 | %0,37 | 1 | %1,92 |
| Kafkas | 2 | %0,75 | - | - |
| Hasan Kalyoncu | 2 | %0,75 | - | - |
| Karamanoğlu Mehmet Bey | 2 | %0,75 | - | - |
| Karabük | 2 | %0,75 | - | - |
| Anadolu Üniversitesi | 1 | %0,37 | - | - |
| Aksaray | 1 | %0,37 | - | - |
| Adıyaman | 1 | %0,37 | - | - |
| Pamukkale | 1 | %0,37 | - | - |
| Gaziantep | 1 | %0,37 | - | - |
| Celal Bayar | - | - | 1 | %1,92 |
| Çankaya | 1 | %0,37 | - | - |
| Çağ 1 | 1 | %0,37 | - | - |
| Dicle | 1 | %0,37 | - | - |
| İstanbul Bilgi | 1 | %0,37 | - | - |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | | | |
|-----------------------------|-----|-------|----|--------|
| İstanbul Ticaret | 1 | %0,37 | - | - |
| İstanbul Kültür | 1 | %0,37 | - | - |
| İstanbul Gelişim | 1 | %0,37 | - | - |
| İstanbul Teknik | 1 | %0,37 | - | - |
| Nişantaşı | 1 | %0,37 | - | - |
| Ege | - | %0,37 | 1 | %1,92 |
| Yalova | 1 | %0,37 | | |
| Cumhuriyet | 1 | %0,37 | | - |
| TOBB | 1 | %0,37 | | - |
| Toros | 1 | %0,37 | | - |
| Ankara Yıldırım Beyazıt | 1 | %0,37 | | - |
| Akdeniz Karpaz Üniversitesi | 1 | %0,37 | | - |
| Gebze Teknik | 1 | %0,37 | | - |
| Necmettin Erbakan | 1 | %0,37 | | - |
| Mustafa Kemal Üniversitesi | 1 | %0,37 | | - |
| Bartın | 1 | %0,37 | | - |
| Giresun Üniversitesi | 1 | %0,37 | | - |
| Yüzüncü Yıl Üniversitesi | 1 | %0,37 | | - |
| On dokuz Mayıs | 1 | %0,37 | | - |
| Nuh Naci Yazgan | 1 | %0,37 | | - |
| Bülent Ecevit | 1 | %0,37 | | - |
| Nevşehir Hacı Bektaş Veli | 1 | %0,37 | | - |
| Niğde | 1 | %0,37 | | - |
| Başkent | 1 | %0,37 | | - |
| Ufuk | 1 | %0,37 | | - |
| Uludağ | - | - | 1 | %1,92 |
| Toplam | 266 | | 52 | %99,80 |

Örgütsel adalet ile ilgili yüksek lisans tezlerinin yazıldığı üniversitelerde ilk üç sırada %6,76 oran ile (18 tez) Marmara Üniversitesi, %5,26 oran ile (14 tez) Bahçeşehir Üniversitesi, %4,88 oran ile (13 tez) Gazi Üniversitesinin yer aldığı; doktora tezlerinde ise %28,83 oranla (15 tez) Marmara Üniversitesi, %9,61 oranla (5 tez) Gazi Üniversitesi ve %9,61 oranla (5 tez) Atatürk Üniversitesinin yer aldığı görülmektedir.

Tablo 9. Tezin Yapıldığı Ana Filim Dalları

| | Yüksek Lisans | Yüzde | Doktora | Yüzde |
|--|---------------|--------|---------|--------|
| İşletme | 123 | %46,24 | 30 | %57,69 |
| Eğitim Bilimleri | 28 | %10,52 | 2 | %3,84 |
| Eğitim Yöneticiliği | 23 | %8,64 | - | - |
| Yönetim ve Organizasyon | 14 | %5,26 | - | - |
| İşletme Yönetimi | 11 | %4,13 | 1 | %1,92 |
| Psikoloji | 8 | %3,00 | 2 | %3,84 |
| İnsan kaynakları Yönetimi | 6 | %2,25 | - | - |
| Kamu Yönetimi | 5 | %1,87 | 1 | %1,92 |
| Savunma Yönetimi | 5 | %1,87 | - | - |
| İlköğretim | 5 | %1,87 | - | - |
| Beden Eğitimi ve Spor Bilimleri | 4 | %1,50 | 5 | %9,61 |
| Çalışma Ekonomisi Ve Endüstri İlişkileri | 4 | %1,50 | - | - |
| Hemşirelik | 4 | %1,50 | - | - |
| Eğitim Yönetimi ve Denetimi | - | - | 3 | %5,76 |
| Sağlık Yönetimi | 3 | %1,12 | - | - |
| Turizm İşletmeciliği ve Otelcilik | 3 | %1,12 | - | - |
| Turizm İşletmeciliği | 2 | %0,75 | 1 | %1,92 |
| İnsan Kaynakları | 1 | %0,37 | 1 | %1,92 |
| Genel İşletme | 1 | %0,37 | 1 | %1,92 |
| Spor ve Sağlık Bilimleri | - | - | 1 | %1,92 |
| Endüstri ve Örgüt Psikolojisi | - | - | 1 | %1,92 |
| Hastane İşletmeciliği | - | - | 1 | %1,92 |
| Sağlık Kalite Yönetimi | - | - | 1 | %1,92 |
| Spor ve Sağlık Bilimleri | - | - | 1 | %1,92 |
| Spor Yöneticiliği | 1 | %0,37 | - | - |
| Sağlık Kurumları Yönetimi | 1 | %0,37 | - | - |
| Hemşirelikte Yöneticilik | 1 | %0,37 | - | - |
| Sağlık Yöneticiliği | 1 | %0,37 | - | - |
| Eğitim Yönetimi Planlaması | 1 | %0,37 | - | - |
| Eğitim Yönetimi Planlaması | 1 | %0,37 | - | - |
| Turizm İşletmeciliği Eğitimi | 1 | %0,37 | - | - |
| Büro Yönetimi | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgüt Psikolojisi | 1 | %0,37 | - | - |
| Gastronomi ve Mutfak Sanatları | 1 | %0,37 | - | - |

| | | | | |
|-----------------------|-----|--------|----|--------|
| Endüstri Mühendisliği | 1 | %0,37 | - | - |
| Seyahat İşletmeciliği | 1 | %0,37 | - | - |
| Sınıf öğretmenliği | 1 | %0,37 | - | - |
| Diğer | 3 | %1,12 | - | - |
| Toplam | 266 | %99,81 | 52 | %99,94 |

Örgütsel adalet konusunda yazılan yüksek lisans tezlerinin bağlı olduğu anabilim dallarında ilk 5 sırada %46,24 ile (123 tez) İşletme, %10,52 ile (28 tez) Eğitim Bilimleri, %8,64 ile (23 tez) Eğitim Yöneticiliği, %5,26 ile (14 tez) Yönetim ve Organizasyon, %4,13 ile (11 tez) ile İşletme Yönetimi programları; doktora tezlerinde ise %57,69 ile (30 tez) İşletme, %9,61 ile (5 tez) Beden Eğitimi ve Spor Bilimleri, %5,76 ile (3 tez) Eğitim Yönetimi ve Denetimi, %3,84 ile (2 tez) Eğitim Bilimleri, %3,84 ile (2 tez) Psikoloji yer almaktadır.

Tablo 10. Tezin Ana Konusu

| | Yüksek lisans | Toplam | Doktora | Toplam |
|-----------------------------|---------------|--------|---------|--------|
| Örgütsel adalet algısı | 60 | %22,55 | 8 | %15,38 |
| Örgütsel adalet | 10 | %3,75 | 10 | %19,23 |
| Örgütsel bağlılık | 37 | %13,90 | 10 | %19,23 |
| İş tatmini | 12 | %4,51 | 2 | %3,84 |
| Örgütsel vatandaşlık | 16 | %5,63 | 6 | %11,53 |
| Örgütsel vatandaşlık algısı | 11 | %4,13 | - | - |
| Etik | 9 | %3,38 | 2 | %3,84 |
| İş doyumu | 9 | %3,38 | - | - |
| Algılanan örgütsel adalet | 6 | %2,25 | - | - |
| Örgütsel sinizm | 5 | %1,87 | - | - |
| Örgütsel güven | - | - | 6 | %11,53 |
| Örgütsel adaletsizlik | 1 | %0,37 | 1 | %1,92 |
| Örgütsel adalet olgusu | - | - | 1 | %1,92 |
| Örgütsel özdeşleşme | 6 | %2,25 | 1 | %1,92 |
| Örgütsel yabancılaşma | - | - | 1 | %1,92 |
| Örgüt kültürü | 2 | %0,75 | 1 | %1,92 |
| Örgüt sessizlik | 5 | %1,87 | 2 | %3,84 |
| Sinizm | 3 | %1,12 | - | - |
| Yabancılaşma | - | - | 1 | %1,92 |
| Motivasyon | 6 | %2,25 | - | - |
| Örgütsel destek algısı | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel adalet ilişkisi | 1 | %0,37 | - | - |

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | | | |
|---|-----|--------|----|--------|
| Örgütsel adalet düzeyi | 1 | %0,37 | - | - |
| İnsan kaynakları | 2 | %0,75 | - | - |
| Güven | 2 | %0,75 | - | - |
| Örgütsel muhalefet | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel algı düzeyleri | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel sapma | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel davranış | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel bağlılık düzeyleri | 1 | %0,37 | - | - |
| Bağlılık | 2 | %0,75 | - | - |
| Örgüt iklimi | 2 | %0,75 | - | - |
| Cam tavan sendromu | 2 | %0,75 | - | - |
| Duygusal bağlılık | 1 | %0,37 | - | - |
| Mobing | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel İnsandışılaştırma | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel sağlık | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel politika | 1 | %0,37 | - | - |
| Örgütsel bağlanma | 1 | %0,37 | - | - |
| İş motivasyon | 1 | %0,37 | - | - |
| İş performansı | 1 | %0,37 | - | - |
| İş davranışları | 1 | %0,37 | - | - |
| İhbarcılık eğilimleri | 1 | %0,37 | - | - |
| Kültürel uyum | 1 | %0,37 | - | - |
| Kültür | 1 | %0,37 | - | - |
| Bürokratik kültür | 1 | %0,37 | - | - |
| Okul | 1 | %0,37 | - | - |
| İnsan kaynakları yönetimi | 1 | %0,37 | - | - |
| Diğer / Paternalistik lider 1 /Liderlik 3 | 4 | %1,50 | - | - |
| Diğer | 31 | %11,65 | - | - |
| Toplam | 266 | %99,37 | 52 | %99,94 |

Yüksek lisans tezlerinin üzerinde durduğu konularda ilk 5 sırada sırasıyla; %22,55 (60 tez) örgütsel adalet algısı, %13,90 (37 tez) örgütsel bağlılık, %5,63 (16 tez) örgütsel vatandaşlık, %4,51 (12 tez) iş tatmini, %4,13 (11 tez) örgütsel vatandaşlık algısı konularının çalışıldığı görülürken; doktora tezlerinde %19,23 (10 tez) örgütsel adalet, %19,23 (10 tez) örgütsel bağlılık, %15,38 (8 tez) örgütsel adalet algısı, %11,53 (6 tez) örgütsel vatandaşlık ve %11,53 (6 tez) örgütsel güven konularının çalışıldığı belirlenmiştir.

Tablo 11. Tezde Kullanılan Veri Toplama Araçları /Teknikleri

| | Tür | Yüksek lisans | | Doktora | |
|----------------------------|-------|---------------|--------|---------|------|
| Anket | Nicel | 258 | %96,99 | 52 | %100 |
| Derinlemesine Görüşme | Nitel | 3 | %1,12 | - | |
| Diğer (Literatür taraması) | Nitel | 4 | %1,50 | - | |
| Meta Analiz | Nitel | 1 | %0,37 | - | |
| Toplam | | 266 | %99,98 | 52 | %100 |

Örgütsel adalet konusunda yazılan yüksek lisans ve doktora tezleri incelendiğinde; yüksek lisans tezlerinde %96,98 ile (257 tez) anket, %1,50 ile (4 tez) literatür taraması, %1,13 ile (3 tez) derinlemesine görüşme, %0,37 ile (1 tez) meta analiz yönteminin kullanıldığı; 52 doktora tezinin tamamında nicel bir veri toplama aracı olan anketin olduğu görülmüştür.

5.SONUÇ VE ÖNERİLER

318 izinli tezin bibliyometrik analiz tekniğiyle incelenmiş olduğu bu çalışmada belirlenen kategoriler çerçevesinde ulaşılan sonuçlar şu şekildedir:

- Yüksek lisans ve doktora tezlerinin izin durumları karşılaştırıldığında, yüksek lisans tezlerinde izin oranının yüksek olduğu görülmektedir. Bu durum yüksek lisans tez sayısının doktora tez sayısına göre yüksek olması ile açıklanabilir.
- Yüksek lisans ve doktora tezlerinin dilleri incelendiğinde, Türkçe dilde yazılan tezlerin %90 oranını geçtiği görülmektedir. Bu durum, örgütsel adalet konusunun çalışıldığı anabilim dallarındaki programların eğitim dilinin Türkçe olması ile ilgilidir.
- Örgütsel adalet konusunda yazılan tezlerin yazarlarının cinsiyetleri incelendiğinde, kadınların sayısının yarısından fazla olduğu görülmektedir. Bu durumun tesadüfi olduğunu söylemek yanlış olmayacaktır.
- 2004 yılında örgütsel adalet konusunda ilk yüksek lisans ve doktora tezlerinin yazıldığı görülmektedir. Yüksek lisans ve doktora tezlerinin en fazla yayınlanmış olduğu yılın 2014 yılında olduğu saptanmıştır. Bunun yanında, 2018 yılına yaklaştıkça konu ile ilgili yayınlanan lisansüstü tezlerde fazla yoğunluk yaşanmaması da dikkat çekicidir.
- Yüksek lisans tez danışmanı unvanlarında doktor öğretim üyelerinin, doktora danışman unvanlarında ise profesör unvanına sahip öğretim üyelerinin sayıca yüksek olduğu görülmektedir.
- Yüksek lisans tezlerinde sayfa sayıları yoğun olarak 101-150 sayfa aralığında yer alırken; doktora tezlerinin ise 151-200 sayfa aralığında olduğu, bu durumun doktora tezlerinin daha kapsamlı olarak hazırlanması ile bağlantılı olduğu söylenebilir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

• Örgütsel adalet konusundaki yüksek lisans ve doktora tezlerinin en çok Marmara Üniversitesi'nde yazıldığı, bu durumun üniversitenin köklü olması, bu konuda çalışan akademisyen sayısının fazlalığı ve örgütsel adalet konusu ile bağlantılı olan programların fazla olması ile açıklanabilir.

• Örgütsel adalet konusunda yazılan tezlerin bağlı olduğu programlarda hem yüksek lisans hem de doktora tezlerinde birinci sırada İşletme programının olduğu belirlenmiştir.

• Örgütsel adalet konusundaki yüksek ve doktora tezlerinin konu başlıklarında 'örgütsel adalet algısı', 'örgütsel bağlılık' ve 'örgütsel vatandaşlık' konularının sıklıkla kullanıldığı görülmektedir.

Bu çalışmada elde edilen verilere göre örgütsel adalet, Türkiye'de lisansüstü tezlerde özellikle bazı yıllarda üzerinde yoğun olarak çalışılmış bir konudur. Ancak, farklı disiplinlerle olan ilişkisinin incelendiği yeni çalışmaların olması önerilebilmektedir. Gelecekte yapılacak çalışmalarda Türkiye'de konu ile ilgili yayınlanan makalelerde incelenerek daha kapsamlı bir çalışma yapılması sağlanabilir.

KAYNAKÇA

Alexander, S. ve Ruderman, M. (1987) "The Role of Procedural and Distributive Justice in Organizational Behavior", *Social Justice Research*, 1(2): 177–198.

Altıntaş, F. Ç. (2006) "Bireysel Değerlerin Örgütsel Adalet ve Sonuçları İlişkisinde Yönlendiric Etkisi: Akademik Personel Üzerinde Bir Analiz", *İşletme Fakültesi Dergisi*, 7(2): 19–40.

Arslantaş, C. C. ve Pekdemir, I. (2007) "Dönüşümcü Liderlik, Örgütsel Vatandaşlık Davranışı ve Örgütsel Adalet Arasındaki İlişkileri Belirlemeye Yönelik Görgül Bir Araştırma", *Anadolu Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi*, 1: 261–286.

Beugre, C. D. (1998) "Managing Fairness in Organizations", Westport, CT: Greenwood Publishing.

Beugre, C. D. (2007) "A Cultural Perspective of Organizational Justice"

Beugre, C.D. ve Baron, R.A. (2001) "Perceptions of Systemic Justice: The Effects of Distributive, Procedural, and Interactional Justice", *Journal of Applied Social Psychology*, 31 (2): 324–339.

Bies, R. J ve Moag, J. S. (1986) "International Justice: Communication Criteria of Fairness". R. J.

Lewicki, B. M., Sheppard ve M. H. Bazerman (eds.) *Research on Negotiations in Organizations* (Vol. 1)(ss. 43–55), Greenwich, CT: JAI Press.

Brashear, T. G., Brooks, C. M. ve Boles, J. S. (2004) "Distributive and Procedural Justice in A Sales Force Context Scale Development and Validation", *Journal of Business Research*, 57(1): 86–93.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Cohen–Charash, Y. ve Spector, P. E. (2001) “The Role of Justice in Organizations: A Meta Analysis” *Organizational Behavior and Human Decision Processes*, 86 (2), 278–321.
- Colquitt, J. A., Conlon, D. E., Wesson, M. J., Porter, C, O. L.H. ve Ng, K. Y. (2001) “Justice At The Millennium: A Meta–Analytic Review of Colquitt 25 Years of Organizational Justice Research”, *Journal of Applied Psychology*, 86 (3): 425–445.
- Cropanzano, R., Byrne, Z. S. ve Bobocel, D. R. (2001) “Moral Virtues, Fairness Heuristics, Social Entities, and Other Denizens of Organizational Justice”, *Journal of Vocational Behavior*, 58(2): 164-209.
- DeConinck, J. B. ve Stilwell, C. D. (2004) “Incorporating Organizational Justice, Role States, Pay Satisfaction and Supervisor Satisfaction in A Model of Turnover Intentions” *Journal of Business Research*, 57(3): 225– 231.
- Elovainio, M., Kivimäki, M. ve Vahtera, J. (2002) “Organizational Justice: Evidence of a New Psychosocial Predictor of Health”, *American Journal of Public Health*, 92(1): 105–108.
- Folger, R. G. ve Cropanzano, R. (1998) “Organizational Justice and Human Resource Management”, California: Sage Publications Inc.
- Fortin, M.ve Fellenz, M. (2008) “Hypocrisies of Fairness: Towards A More Reflexive Ethical Base in Organizational Justice Research and Practice”, *Journal of Business Ethics*, 78: 415–433.
- Greenberg, J. (1993) “The Social Side of Fairness: Interpersonal and Informational Classes of Organizational Justice”, R. Cropanzano (ed.), *Justice in the Workplace: Approaching Fairness in Human Resource Management* (ss. 79–103), Hillsdale, NJ: Erlbaum.
- Klendauer, R. ve Deller, J. (2009) “Organizational Justice and Managerial Commitment in Corporate Mergers”, *Journal of Managerial Psychology*, 24 (1): 29–45.
- Konovsky, M. A. (2000) “Understanding Procedural Justice and its Impact on Business Organizations”, *Journal of Management*, 26(3): 489-51.
- Konovsky, M. A. ve Pugh, S. D. (1994) “Citizenship Behaviour and Social Exchange”, *Academy of Management Journal*, 37(3): 656–669.
- Lambert, E. G., Hogan, N. L. & Griffin, M. L. (2007) “The Impact of Distributive and Procedural Justice on Correctional Staff Job Stress, Job Satisfaction, and Organizational Commitment”, *Journal of Criminal Justice*, 35(6): 644–656.
- Leventhal, G. S. (1980) “What Should Be Done With Equity Theory? New Approaches to The Study of Fairness in Social Relationships”, K. Gergen, M. Greenberg ve R. Willis (eds.), *Social Exchanges: Advances in Theory and Research* (ss. 27–55), New York: Plenum.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- McFarlin, D. B. ve Sweeney, P.D. (1992) "Distributive and Procedural Justice as Predictors of Satisfaction with Personal and Organizational Outcomes", *The Academy of Management Journal*, 35 (3): 626-637.
- McDowall, A. ve Fletcher, C. (2004) "Employee Development: An Organizational Justice Perspective", *Personnel Review*, 33(1): 8-29.
- Moorman, R. H. (1991) "Relationship between Organizational Justice and Organizational Citizenship Behaviors: Do Fairness Perceptions Influence Employee Citizenship?" *Journal of Applied Psychology*, 76(6): 845-855.
- Moorman, R.H., Niehoff, B.P. ve Organ, D.W. (1993) "Treating Employees Fairly and Organizational Citizenship Behavior: Sorting the Effects of Job Satisfaction, Organizational Commitment and Procedural Justice", *Employee Responsibilities and Rights Journal*, 6(3): 209-225.
- Mossholder, K.W., Bennett, N., ve Martin, C.L. (1998) "A Multilevel Analysis of Procedural Justice Context" *Journal of Organizational Behavior*, 19(2), 131-141.
- Nabatchi, T., Bingham, L. B. ve Good, D. H. (2007) "Organizational Justice and Workplace Mediation: A Six-Factor Model. *International Journal of Conflict Management*", 18:148-174.
- Olkkonen, M. E. ve Lipponen, J. (2006) "Relationships between Organizational Justice, Identification with Organization and Work Unit, and Group-Related Outcomes", *Organizational Behavior and Human Decision Processes*, 100(2), 202-215.
- Özer, G. ve Günlük, M. (2010) "Örgütsel Adaletin Muhasebecilerin İş Memnuniyeti ve İşten Ayrılma Eğilimine Etkisi", *Gaziantep Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi*, 9(2): 459-485.
- Rawls, J. (1999) "A Theory of Justice" Cambridge: Harvard University Press.
- Samiee, Saeed – Chabowski, Brian R (2012), "Knowledge Structure in International Marketing Multi-Method Bibliometric Analysis", *Journal of the Academy of Marketing Science*, Cilt: 40, Sayı: 2, ss. 364-386
- Scandura, T. A. (1999) "Rethinking Leader-Member Exchange: An Organizational Justice Perspective", *Leadership Quarterly*, 10(1): 25-40.
- Sheppard, B. H., Lewicki R. J. ve Minton J. W. (1992) "Organizational Justice: The Search for Fairness in the Workplace", New York: Lexington Books.
- Smither, J. W., Reilly, R. R., Millsap, R. E., Pearlman, K. AT&T, Stoffey, Ronald W. (1993). Applicant Reactions to Selection Procedures. *Personnel Psychology*, 46 (1): 49-76.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Sweeney, P. D. & McFarlin, D. B. (1997) "Process and Outcome: Gender Differences in the Assessment of Justice", *Journal of Organizational Behavior*, 18(1): 83–98.

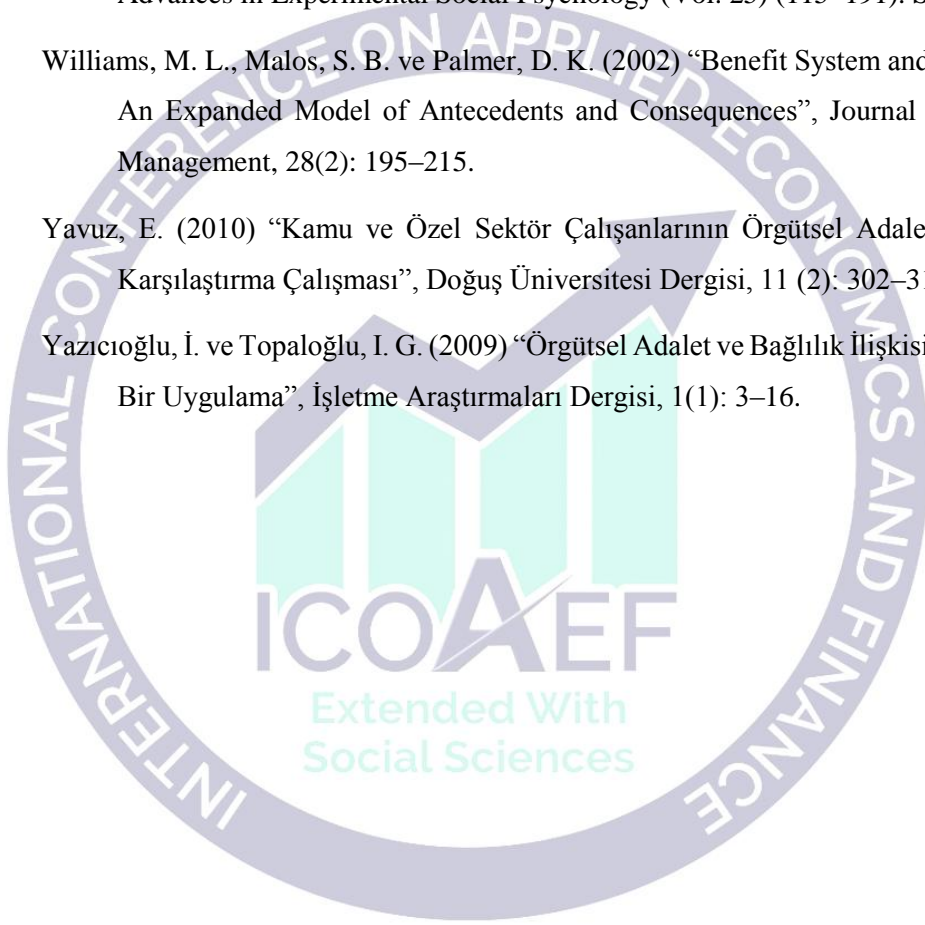
Tutar, H. (2007) "Erzurum'da Devlet ve Özel Hastanelerde Çalışan Sağlık Personelinin İşlem Adaleti, İş Tatmini ve Duygusal Bağlılık Durumlarının İncelenmesi", *Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi*, 12 (3): 97–120.

Tyler, T. R., & Lind, E. A. (1992). A Relational Model of Authority in Groups. In M. P. Zanna (Ed.), *Advances in Experimental Social Psychology* (Vol. 25) (115–191). San Diego: Academic Press.

Williams, M. L., Malos, S. B. ve Palmer, D. K. (2002) "Benefit System and Benefit Level Satisfaction: An Expanded Model of Antecedents and Consequences", *Journal of Management Journal of Management*, 28(2): 195–215.

Yavuz, E. (2010) "Kamu ve Özel Sektör Çalışanlarının Örgütsel Adalet Algılamaları Üzerine Bir Karşılaştırma Çalışması", *Doğuş Üniversitesi Dergisi*, 11 (2): 302–312.

Yazıcıoğlu, İ. ve Topaloğlu, I. G. (2009) "Örgütsel Adalet ve Bağlılık İlişkisi: Konaklama İşletmelerinde Bir Uygulama", *İşletme Araştırmaları Dergisi*, 1(1): 3–16.



**ÇAY TÜKETİMİNDE MOTİVASYONEL FAKTÖRLERİN İNCELENMESİ: NİTEL BİR
ARAŞTIRMA¹**

Dr. Öğr. Gör. Meltem ÖZTÜRK*

Doç. Dr. Aybeniz AKDENİZ AR**

ÖZET

Son yıllarda pazarlama kararlarının alınmasında müşteri iç görüşünün araştırılıp analiz edilmesi, doğru ve pazara uygun, pazarlama kararları ile pazara çıkma konusunda, ulusal ve uluslararası pazarlarda başarıyı belirleme noktasında önemlidir.

Bu araştırmanın amacı, çay tüketicilerinin tüketim alışkanlıklarının motivasyonel nedenlerini belirlemek ve müşteri iç görüşünü araştırmaktır. Çalışma çay tüketiminin motivasyonel faktörlerini araştırmak üzerine odaklanmıştır. Çalışmanın araştırılması, hem ulusal hem de uluslararası pazarda çay marka yaratıcılarının pazara girme ve pazara tutunmalarında, bakış açılarını geliştirmesi açısından önemlidir.

Çalışmanın amacına bağlı olarak, 2018 yılı içinde Ocak ve Ekim ayları arasında, her yaş aralığından, çoğunluğu Balıkesir, Denizli ve İstanbul'da ikamet eden farklı demografik özelliklere sahip 25 çay tüketicisi ile yüz yüze yaklaşık 40-60 dakika arasında değişen derinlemesine mülakat yapılmıştır. Araştırmada nitel araştırma desenlerinden araştırmanın doğasına uygun olan olgubilim (fenomoloji) deseni kullanılmıştır. Araştırma verileri, araştırmacıların geliştirdiği yarı yapılandırılmış açık uçlu görüşme formu aracılığıyla elde edilmiştir. Verilerin çözümlenmesinde içerik analizi türlerinden kategorisel analiz kullanılmıştır.

Araştırma sonucunda, katılımcılara çayı nasıl pişirdikleri sorulduğunda, özenle tarif verilmektedir. Kullanıcılar çay içmenin de, çayı yapmanın da bir kültür olduğunu söylemişlerdir. Kullanıcıların dörtte üçü alışkanlığı olmasını, sevmesi ve yorgunluğuna iyi gelmesini, aileden gelen bir süreklilik olduğunu, bir şey yemek esnasında mutlaka gereksinim duyduklarını ve iş nedeniyle yapılan sohbetlerde mutlaka tercih edildiğini, sağlığa faydalı olduğunu belirtmişlerdir. Ayrıca çay içmenin bir sosyalleşme aracı olduğunu İnsanların birbiriyle iletişim kurmasını sağlayan, iletişimi başlatan, iş toplantılarında / satış anında ikram edilen, insanları üzüntülü ya da sevinçli zamanlarında bir araya

¹ Bu çalışma, Pamukkale Üniversitesi BAP birimi tarafından 2018KKP176 numaralı proje ile desteklenmiştir.

* Pamukkale Üniversitesi, Honaz MYO., Pazarlama ve Reklamcılık Bölümü, Afşin Bey mah., Türkcan sk. , No. 3, 2.kat, 20330, Honaz/Denizli/ Türkiye, mozturk@pau.edu.tr

** Bandırma Onyedil Eylül Üniversitesi, İİBF. , İşletme Bölümü, Yeni Mahalle Şehit Astsubay Mustafa Soner Varlık Caddesi No:77, 10200 Bandırma/Balıkesir, aybenizar@gmail.com

getiren, belli ikramların yanında mutlaka verilmesi öngörülen bir faktör olarak görülmektedir. Araştırmada bu desenler elde edilmiştir. Ancak kahve seven ve tüketen bireyler çayı tercih etmemektedir. Yani bu noktada “çaycılar” ya da “kahveciler” diye bir ayırım yapılabilir.

Anahtar kelimeler: Çay, Çay Tüketiminin Motivasyonel Faktörleri, Nitel Araştırma, Tüketim İlgörülere

1.GİRİŞ

Dünya nüfusunun üçte ikisinin tükettiği, sudan sonra en önemli iecek olan ve insan vücudunu birçok yönden etkileyen çay, 4000'den çok kimyasal madde içermektedir. Toplumlar çayı binlerce yıldır içmektedirler. Çayın ilk sözü edildiği zaman, 5000 yıldan öncedir (Çelik, 2006:642).

Çayın tarihine bakılınca, çay konusunda ilk geniş çaplı araştırma M.S. 733-804 yılları arasında yaşayan Lu Yu' ya aittir. "Çay Kitabı" adlı eserinde, çay hakkında; üretiminden tüketimine, sistemli ve kapsamlı bilgi vermektedir. Böylece çay üretimive tüketimi daha da yaygınlaşma imkânı bulmuştur. Avrupa'nın bu tat ilebuluşması 17. yüzyılda gerçekleşir. İngilizler, sağlık ve zindeliğın sunulduğu busıcak ieçeği o kadar çok benimserler ki, bunu bir yaşam tarzı haline getirirler adeta. Türklerin çayla tanışması gerçek anlamda 19. yüzyılda olmuştur.19. yüzyılın sonlarına doğru Doğu Karadeniz halkının çay yetiştirdiği ve ilkelmetotlarla işleyip elde ettikleri ürünü kullandıkları ve sattıkları bilinmektedir (Sayılı ve Gözener, 2013; Harman, 2014).

Çayı sıradan bir bitki iken gündelik hayatımızın bir parçası haline getiren vebugün temel gıda maddeleri arasında sayılmasını sağlayan etkenler nelerdir diyebaktığımızda, en önemli etkenin üretim artışıyla birlikte aynı zamanda tüketicikitlelerin de yaratılması olduğu görülmektedir (Genç, 2010, 149-150).

“İşletmecilik pazarlama ile başlayıp pazarlama ile devam eden bir süreçtir”.Üretilen ürün ne kadar tercih edilir ve özel olursa olsun, şayet satılamıyorsa ve pazar çeşitliliği yaratılamıyorsa hiçbir kıymete sahip değildir. Pazarlama argümanının en önemli ayağı ulaşım kanallarıdır. Çay üretilen yerleresanayi yatırımlarının yapılması ya da çayın üretildiği yerden, sanayi yatırımlarınıyoğun olduğu yerlere hızlı ve ucuz yoldan ulaştırılması, ulaşım kanallarının çeşitliliği ve kalitesi ile ilgilidir. Havayolu, Deniz Yolu, Demiryolu, güvenli Karayolu gibi (Harman, 2014).

Çay kullanımı ve kültürü ülkemizdeuzun bir geçmişe sahip değildir. Türklerin yaşamına geç girmesine karşın, bugün oluşturduğu kültürü ile birlikte sosyal yaşamda yeri doldurulamayacak bir değer haline gelmiştir. Birçok kültür tarafından el üstünde tutulan bu iecek, Türk kültürüne hızlı uyum sağlamış, bu kaynaşma sonucunda üretilmesinden tüketilmesine kadar birçok düşünsel zenginlik yaratmıştır. Özellikle siyah çay, bugün ülkemizinen çok sevilen ve tüketilen iecekleri arasındadır (Euromonitor International, 2009).Türkiye'de günde yaklaşık 245.000.000 bardak çay tüketmektedir

(Hürriyet, 2010). Bu rakam yılda kişi başına 1250 bardak çaya (yaklaşık 1400 litre veya 3 kg/yıl dökme çay) denk gelmektedir. Türkler çayın %65'ini evde, %13'ünü iş yerinde, %11'ini misafirlikte, %5'ini kafede, %4'ünü kahvelerde ve %2'sini okullarda tüketmektedir. Her yüz Türk'ten 96'sı her gün çay içmektedir. Bu çalışmada çay tüketimi ve kültürel açıdan tüketici tercihleri ve eğilimlerini etkileyen motivasyonel faktörleri incelenecektir. Fenomolojik bir konu olmasından çay ile ilgili bir araştırma yapılması istenmiştir. Gerçekten de Türkiye'de nereye gidilirse gidilsin çay teklif edilir, misafir gelmeden çayı hazırlanır. Bununla beraber salt çay hazırlamak için çay ocakları, çayhaneler ve bu işi meslek edinmiş çaycılar bulunur. Her ne kadar adı kahve ile anılsa da kahvehanelerin artık çoğunda kahvenin yerini kahveden daha ucuz, temini kolay olan çay almıştır.

2. KURAMSAL ÇERÇEVE

Motivasyon, birçok değişik açıdan ele alınmış ve farklı tanımlar yapılmıştır. Genç (2004), motivasyon kavramını, insanların bir ihtiyacını karşılamak için başlatılan bir eylem olarak ifade etmektedir. Koçel (2003), ise motivasyon kavramını; kişilerin bir amaca yönelik olarak kendi istek ve arzuları ile davranmaları olarak tanımlamaktadır. Bireyleri motive eden faktörler çeşitlidir ve bu faktörler kişiden kişiye değişiklik gösterir. Bireylerin psikolojik yapıları, buna bağlı olarak da onları motive edecek araçlar birbirlerinden farklıdır. Literatürde 200'ü aşkın motivasyonel faktör bulunmaktadır (Çalışkan vd., 2011). Motivasyon terimi, gerçekte, bir bireyi birtakım etkilere maruz bırakarak, onun bu etkiler olmadan önce göstereceği davranıştan başka bir biçimde hareket etmesini sağlamayı ifade etmektedir. Böylece, bireyin davranışında gözlenebilir bir değişikliğin meydana gelmiş olması, onun güdülenmesini ifade eder (Topaloğlu, 2006). Motivasyon sürecini tam olarak kavrayabilmek için kişileri belirli şekillerde davranmaya zorlayan nedenleri, kişinin amaçları, davranışların sürdürülme olanakları gibi konuların incelenmesi gerekmektedir (Çiflikli Kaya ve Yalçıntaş, 2016).

Günümüzde genel olarak işletmecilikte geniş ölçüde davranış bilimlerinden yararlanılmakta ve konular, disiplinlerarası bir yaklaşımla açıklanmaya çalışılmaktadır. Karmaşık ve farklı birçok faktöre bağlı olan tüketici satın alma kararları veya tüketici davranışlarını açıklamada davranış bilimleri çok yararlı ipuçları vermektedir. Tüketicinin karar sürecinde sosyal, psikolojik ve kişisel nitelikte çeşitli faktörler belirleyicidir. Bunlar pazarlamacının kontrol edemediği ancak alım kararlarına etkisini göz önünde bulundurmak durumunda olduğu faktörlerdir (Mucuk, 2016). Bu çalışmada motivasyonel faktörlerin belirlenmesinde bu ana faktörler üzerinden tüketicinin karar sürecini etkileyen motive edici (güdüleyici) faktörler üzerinden hareket edilmiştir. Müşteri iç görüşünün araştırılıp analiz edilmesi motivasyonel faktörlere dayandırılarak, doğru ve pazara uygun, pazarlama kararları ile pazara çıkma konusunda markalara yol gösterici nitelikte olacaktır. Tüketicilerin satın alma davranışını da etkileyen tüm bu motivasyonel faktörlerin incelenmesi, tüketicilerin istek ve ihtiyaçların anlaşılmasını

sağlamaktadır. Bu durum pazarlamacıların tüketiciyi tatmin edecek politikalar benimsenmesini kolaylaştırmaktadır.

İlgili yazına bakıldığında Türk çay kültürü üzerine kitaplar bulunup, uluslararası makalelerin çoğu sağlık ve tıp sektöründe yapılan çalışmalara bağlıdır. Az da olsa çay tüketimi ve çay kültürü ile ilgili birkaç çalışma bulunmaktadır (Harman, 2014; Kılıç, vd., 2012; Güneş, 2012; Sayılı ve Gözener, 2013; Çelik, 2006 Horng, J. S., Hong, J. C., & Lin, Y. C. (2011)). Nicel araştırma teknikleri ile incelenen çalışmalar varken, nitel çalışma son derece sayılıdır. Bu da çalışmanın önemini arttırmaktadır.

3. ARAŞTIRMANIN YÖNTEMİ

Burada araştırmanın methodolojik olarak nasıl yürütüldüğü açıklanacaktır.

3.1. Araştırmanın Modeli ve Önemi

Araştırma nitel desende oluşturulmuştur. Nitel araştırma yöntemi, doğal ortamda gerçekleştirildiği için yaşananları anlama, anlamlandırma ve daha sağlıklı yorumlamalar getirmeye elverişli bir yöntem türüdür. Araştırmada nitel araştırma desenlerinden araştırmanın doğasına uygun olan olgubilim (fenomoloji) deseni kullanılmıştır. Olgubilim deseni, aslında bilinen fakat açıklamada bulunurken bilimsel bulgulara dayalı olarak net söylemler üretilemeyen olguları derinlemesine inceleme fırsatı sunan ve zengin söylemler oluşturarak yorumlamalarda bulunma olanağı veren bir araştırma desendir (Yaman, 2010a). Tüketim konusunda motive edici faktörleri araştırmak için gözlem ve mülakat gibi niteliksel yöntemler kullanarak, görüneni değil olgunun altında yatan durumu daha sağlıklı ortaya çıkarmak mümkündür. Nitel araştırmanın doğası gereği, bu araştırma sonuçları genellenememekte, ancak çay tüketimini etkileyen motivasyonel faktörlere ilişkin derinlemesine veriler sunmaktadır. Aynı zamanda konu ile ilgili ileride yapılabilecek daha büyük verilerle nitel analiz ya da nicel analize dayalı araştırmalar yapmak için ön araştırma niteliği taşımaktadır.

3.2. Çalışma Grubu / Verilerin Toplanması ve Analiz Yöntemi

Araştırma sorunsalının çözümüne yönelik olarak problemi daha net görerek yorumlamacı bir yaklaşım getirmek istenmektedir. Bu nedenle hem gözlem hem de derinliğine mülakat yöntemlerinin avantajlarından yararlanmak üzere oluşturulan odak (focus) gruplar yöntemi ile farklı demografik özelliklere sahip katılımcılardan yararlanılmıştır. Bu amaçla 2018 yılı içinde Ocak ve Ekim ayları arasında, her yaş aralığından, çoğunluğu Balıkesir, Denizli ve İstanbul'da ikamet eden farklı demografik özelliklere sahip 25 çay tüketicisi ile yüzyüze yaklaşık 40-60 dakika arasında değişen derinlemesine mülakat yapılmıştır.

Araştırma verileri, araştırmacıların geliştirdiği yarı yapılandırılmış görüşme formu aracılığıyla elde edilmiştir. Görüşme formu, araştırmacılar tarafından hazırlanmış ve iki öğretim üyesi tarafından kapsam geçerliliği gözden geçirilmiş sorulardan oluşturulmuştur. Bu araştırmada kodların ve

kategorilerin elde edildiği tüketici görüşlerinden bire bir alıntı yapılarak 'geçerlilik' sağlanmıştır (Patton, 1987).

Araştırmada analitik genelleme yapılarak (sınırlı sayıda katılımcıdan elde edilen verilerin ışığında bazı sonuç / kuramlara ulaşma) veri toplama aşamasında mülakat (görüşme) ile elde edilen bilgiler düzenlenip içerik analizi ile yorumlanmıştır. İçerik analizi için gerekli zorunluluklar, bilimsel metotların yazılı delillere dayanarak uygulanmasını ifade eder. Ayrıca güvenilirlik, olayların (öğelerin) farklı gözlemciler tarafından aynı kategoriye bağlanması ya da aynı gözlemci tarafından farklı zamanlarda aynı kategori ile ilişkilendirilmesidir. Bu çalışmada her iki açıdan da her araştırmacı tarafından kontroller yapılarak güvenilirlik sağlanmıştır. Bununla birlikte bir diğer kavram olan geçerlilik, "gerçek: ilgili sosyal fenomeni doğrulukla tescil eden" yorumlamalardır. Bu çalışmada sosyal bir fenomen olan çay kültürü için değerlendirmeler fenomolojik bir araştırma niteliğinde sağlanmıştır (Altunışık vd., 2005).

Araştırmada içerik analizi türlerinden 'kategorisel analiz' kullanılmıştır. Kategorisel analiz, genel olarak belirli bir mesajın önce birimlere bölünmesi ve ardından bu birimlerin önceden saptanmış ölçütlere göre kategoriler hâlinde gruplandırılmasıdır (Tavşancıl ve Aslan, 2001). Kategorilerin belirlenmesinde, ilgili alanyazının yanı sıra bulgularda ortaya çıkan kavramlar kullanılmış ve değerlendirilmiştir. Ham verilerin kodlara ve kategorilere dönüştürülmesi işlemi, birinci yazar ve bir başka öğretim üyesi tarafından gerçekleştirilerek 'güvenilirlik' işlemleri yapılmıştır. Geçerlilik ve güvenilirlik açısından yukarıda da açıklandığı gibi çalışmanın ilerlemesindeki her aşamada gerekenler birçok açıdan yapılmıştır.

En fazla beşer gruplar halinde ve bazı katılımcılarla birebir olmak üzere rahat ve informal bir ortamda, yüz yüze, yaklaşık 40-60 dk arasında değişen sürelerde yapılan derinlemesine mülakatlarda (görüşme) bir moderatör ve bir gözlemci bulunmuştur. Görüşme başlatılırken önce çalışma ile ilgili bilgi verilmiş, daha sonra önceden hazırlanan sorular ile görüşmeye başlanmıştır. Soru kağıdı, açık uçlu sorulardan oluşmakta olup niteliksel bir çalışma olması ve algılamaya yönelik bilgi toplandığı için mümkün olduğunca veri kaybı yaşamamak için açık uçlu sorular kullanılmıştır. Görüşmenin soru kağıdının okunduğu, soru cevap şeklinde bir görüşme olmamasına sohbet ortamı içinde doğal olmasına özen gösterilmiştir. Gözlemci oturum boyunca sürekli ses kaydı tutmuştur.

4. BULGULAR

Odak grupları görüşmelerindeki sorulara verilen yanıtlara bakıldığında çay kullanıcılarının tüketimine bağlı olan motivasyonel faktörler; çay tüketimine ilişkin nedensel özellikler, ihtiyaç ve istek ile ilgili faktörler, kişisel, sosyal, alışkanlık, eğlence / iletişim, sağlık ve çay ile ilgili sembolik anlamlandırmalar biçiminde sekiz kategoride sınıflandırılmıştır.

4.1.Çay Tüketimine İlişkin Nedensel Özellikler

25 katılımcının, 4'ü çok nadiren, 4'ü yalnızca kahvaltıda, 6'sı her öğünde olmak üzere günde en az 5 bardak içerken, 11'i yani çoğunluğu günde 10 bardaktan fazla hatta birkaç demlik tüketmektedir. Çok sık çay tüketen kullanıcılar ev sevdikleri içecek sıralamasında ilk birkaç sırayı çaya vermektedir. Kullanıcıların çoğu şekerli / az şekerli ve orta demde çay tükettiklerini belirtmişlerdir. Yine çoğu çayın sunumunun özelliğine (bardağı, temizliği, şıklığı vb.) ve yanında yiyecek bir şeyler olmasına dikkat ettiklerini söylemişlerdir.

(K1)- *“Tavşan kanı içerim. Açık olursa çayın tadını alamazsın koyu olursa acı olur.”*

(K8)- *“Şekersiz içerim. Şeker kullanmayarak çayın tadını daha iyi aldığımı düşünüyorum.”*

(K12)- *“Az şekerli çay tercih ediyorum.”*

(K9)- *“Şöyle söyleyeyim.Limonlu içmem şekerde bir küp şeker atarım genelde.”*

(K22)- *“Zaman zaman tek şekerli içiyorum.Açık içtiğimiz zamanlarda oluyor. Gün içerisinde çok çay tüketirim.Uykum kaçtığı için akşam içtiğim çayları açık tüketmeyi tercih ediyorum.”*

(K15)- *“Sunum benim için önemlidir. Çay kaşığında ki su damlacıklarını sevmem çay tabağı olursa iyi olur.”*

(K24)- *“Evet severim bardağın temiz ve parlak, ince belli olması önemli. Çayımın berrak, sıcak ve çayın kıvamında olmasını severim.”*

(K13)- *“Önemlidir.Şekersiz içmeme rağmen kaşık olmasını isterim.”*

(K20)- *“Çayla birlikte bütün yiyecek ve içeceklerin sunumu önemlidir.”*

(K2)- *“Evet dikkat ederim en azından hani iştahla içilmesini etkileyen bir faktör olarak görüyorum sunumu.”*

Ayrıca çayı nasıl pişirdikleri sorulduğunda da, özenle tarif verilmektedir. Kullanıcılar çay içmeninde, çayı yapmanın da bir kültür olduğunu söylemişlerdir.

(K1)- *“Kuru çayı soğuk suyla yıkayıp çaydanlıkta ki su 15 dakika kaynadıktan sonra çayların üzerine direk sıcak su gelmeyecek şekilde demlerim. Demliği ocağın üzerine koyarım iki üç fokurdadıktan sonra çaydanlığın üzerine koyar,kaynayan suyun üzerinde 15 dakika demlenmesini bekledikten sonra afiyetle içmeye hazır olur.”*

(K24)- *“Kendi yaptığım çay daha güzeldir. Suyumu kaynattıktan sonra suyumu koyarım daha sonra çayımı koyarım çayıma bergamot yada tomurcuk aromasıyla tatlandırırım üzerine belirli miktarda şeker koyarım acılığını alsın diye.”*

(K14)- *“Önce çayı yıkarım sonra demliğe alırım üzerine kaynar suyu dökerim sonra 25-30 dk demlenme payı bırakırım. Sonra ocağı kısığa alırım.”*

(K19)- “Çaydanlığın alt tarafına 3 te 2'ni geçmeyecek şekilde su dolduruyorum. Bu suyu kaynatıyorum.Sonra çaydanlığın üst tarafına kaç kişi içeceksek kaç kişi için demliyorsak bir miktar göz kararı çay koyuyorum.İçine de küp şeker atıyorum ki çayın acılığını alsın diye.Ondan sonra alt tarafta kaynayan suya üst taraftaki çayın üzerine ekliyorum.Tekrar alt tarafa soğuk su dolduruyorum.”

(K13)- “Tabi ki. Tek demlik şeklinde hoşuma gitmez. Demlik ve çaydanlık şeklinde altlı üstlü demlerim.Birkaç kaşık çay atarım demliğe alttaki suyu kaynayıncaya çayı demlerim sonrasında yine su katıp hem su kaynatıp hem de çayın demini almasını beklerim.Demlendiğini de çay tanelerinin dibe çökmesinden anlarız.Çay ikinci defa ısıtıldığında tadı bozulur ben ikinciye ısıtmam genelde.”

4.2.İhtiyaç ve istek İle İlgili Faktörler

Çay tüketmelerinin nedenlerini açıklayan kullanıcılar şunları belirtmişlerdir: Alışkanlığı olması, sevmesi ve yorgunluğuna iyi gelmesi, aileden gelen bir süreklilik olduğunu, bir şey yemek esnasında mutlaka gereksinim duyduklarını ve iş nedeniyle yapılan sohbetlerde mutlaka tercih edildiğini.

(K2)- “Hem alışkanlık hem de sevdiğim için”

(K3)- “Yorgunluğumu giderdiğini düşünüyorum ve sabahları içtiğimde de daha zinde oluyorum.”

(K5)- “Bu bizim gelenek görenek ve adetlerimizde olan bir şey, doğduğumuzdan beri ailemizin en çok tükettiği içecek olduğu için bizlerde bunu çok sevdiğimiz için çay ve ayran bizim için baş içeceklerden biri.”

(K17)- “Bir yerde otururken güzel gidiyor.”

(K20)- “Benim işim gereği bir mecburiyet çünkü masaya oturduğumuzda onunla beraber eşlik etmek anlamında onunla beraber içmek zorundasınız. Her işletmenin devamlı misafiri devamlı müşterisi var o çayı içmek zorundasınız işletme sahibi olarak.”

(K4)- “Belli yiyeceklerin yanında çay arıyoruz. Orada bir istek uyandırıyor.”

(K6)- “İstek derken bazen gruplar halinde toplandığımızda kekler, börekler yapıldığında tabii ki yanında çay olmadan olmaz. Bazı akşamlar ailemizle oturduğumuzda çoluk çocuk birlikte çekirdek çatlattığımızda çaysız yine olmaz. Bunlar benim için istek faktörüdür.”

4.3.Kişisel Faktörler

Kullanıcılar çay tüketim nedenlerini kişisel olarak açıklamışlardır. Yorgunluğunu alması, keyif vermesi, bağımlılığı olması, sıcak bir şeyler içmekten hoşlanması gibi faktörleri belirtmişlerdir. Çay alışkanlığı olmayan kullanıcılar ise tadından memnun olmadığı için hemen hemen hiç içmediğini söylemişlerdir. Ya çok sevmek ya da hiç sevmemekten ötürü kullanım sıklıkları doğrudan değişmektedir.

(K1)- *“Yorgunluğumu aldığını söyleyebilirim.”*

(K2)- *“Damak tadına uygun olan berrak, sıcak ve taze çayı keyifle içmekten hoşlanırım. Çayı zorunluluk için değil keyifle içmekten yanayım.”*

(K5)- *“İçmediğim gün yokken genelde arıyoruz. Çaya bağımlıyız.”*

(K14)- *“Kişisel olarak çayı sevdiğim için içiyorum.”*

(K20)- *“Kişisel olarak severim ama çoğunlukla işimden dolayı içiyorum.”*

(K24)- *“Beni çok memnun etmez. Acı gelir tadı.”*

4.4.Sosyal Faktörler

25 katılımcıdan 23'ü çay içmenin bir sosyalleşme aracı olduğunu belirtmişlerdir.

(K4)- *“Çay bir sosyalleşme aracıdır. Arkadaşlarla buluşma sebebidir. Önemli bir kültür objesi olduğunu düşünüyorum.”*

(K20)- *“Evet eski dostlarla bir araya geldiğimizde içeriz”*

(K2)- *“Tavla oynarken, oyun oynarken”*

(K5)- *“Ben sosyal bir insanım gün içerisinde mutlaka görüşürüm. Görüştüğümüzde de çaysız asla olmadığı için hatta bu çaylar arkası arkasıya içildiği için günü mutlaka bir demlik çayla bitirmeye çalışıyorum. Arkadaşlarım da benim gibi çayı çok seviyorlar.”*

(K11)- *“Tabi. Aile arasında, misafirler geldiğinde ikram ilk akla gelen çay olur.”*

(K24)- *“Evet sosyalleştirir. Muhabbet aracıdır. Bende o zamanlarda belki içiyorum.”*

(K4)- *“Ailemde çay kültürü gelişmiştir. Hemen hemen her akşam evde çay demlenir. Afiyetle içilir.”*

(K13)- *“Tabi yani sosyal faktör olarak değerlendirmek zordur çünkü çocukların olduğu bir ortamda çay içmek gerçekten bir zülüm gibidir. Her an dökülme ihtimali var ama sosyal olarak arkadaşlarla içmek hakikaten güzeldir. Kahve gibi değildir çayın sohbeti, muhabbeti her zaman daha güzeldir.”*

4.5.Alışkanlık Faktörü

Sabah kahvaltısı ve yemek yeme alışkanlıkları ile ilgilidir. 25 katılımcıdan 2'si alışkanlığı ya da bir bağımlılığı olmadığını söylemiştir.

(K1)- *Genel de her zaman içerim yemeklerden sonra veya önce olabilir. Öğle aralarında da içerim.*

(K4)- *Sabah kahvaltılarında limonlu çayı tercih ederim. Öğlen ve akşam yemeğinin tamamlayıcısı olarak Türk kahvesi tercih ederim.*

(K5)- *Gerçekten çay bizim için büyük bir alışkanlık daha öncede dediğim gibi ailemizde doğduğumuzdan beri gördüğümüz tek şey çaydır. Sudan sonra gelen alışkanlıklardan biri bana göre. Bu yüzden zaman dilimi hakkında çok fazla bir şey söyleyemiyorum. Ama gün içerisinde 3-4 kere demlediğimde olabiliyor. Yemek sonrasında tabii ki tamamlayıcı bazen yemek yanında balıktan sonra çok güzel oluyor. O benim için çok büyük bir alışkanlık.*

(K18)- *Benim için bir alışkanlık. Çaysız bir hayat düşünemiyorum.*

(K17)- *Alışkanlık değil bende ki .*

4.6.Eğlence ve İletişim Faktörü

İnsanların birbiriyle iletişim kurmasını sağlayan, iletişimi başlatan, iş toplantılarında / satış anında ikram edilen, insanları üzüntülü ya da sevinçli zamanlarında bir araya getiren, belli ikramların yanında mutlaka verilmesi öngörülen bir faktör olarak görülmektedir. Ancak kahve seven ve tüketen bireyler çayı tercih etmemektedir. Yani bu noktada “çaycılar” ya da “kahveciler” diye bir ayırım yapılabilir. Katılımcıların hepsi çay tüketmenin motive edici ana unsuru olarak bu faktörü belirtmişlerdir.

(K4)- *“Günlerde, arkadaş ve iş toplantılarının tamamlayıcısıdır. Yaz gecelerinde çekirdekle çok iyi gider. Kışın patlamış mısırla içilir. Dizi izlenirken de keyifle içilir.”*

(K11)- *“Tabii. Eğlence beraberinde kahvaltı onunla gider.”*

(K13)- *“Kültürümüz açısından da benim açımdan da yemeğe geliyoruz demeyiz de çaya geliyoruz deriz.”*

(K5)- *“Çay içerken iyi vakit geçiriyorum. Niye? Dantel örerken çay içmeyi çok seviyorum. Yorgunluğumu aldığı için çok severim. Kitap okurken yanında arkadaş olduğu içinde severim. Bu yüzden de çay içerken iyi vakit geçiriyorum.”*

(K4)- *“Çay iletişime başlamada önemli bir faktör olduğunu düşünüyorum. Hadi gel çay içelim sana çay ısmarlayayım bu tip konuşmalar sohbet başlatan konuşmalardır.”*

(K5)- *“Ben 12 yıldır gelinlik sektöründe çalışıyorum. Bu gençler için önemli bir detay olduğu için daha anlaşılır bir şekilde yardımcı olabilmemiz için iletişime geçiyoruz ve bu arada çay ısmarlıyoruz. Çaylar içilirken sohbet ilerliyor onların arzu ve isteklerine göre yol almaya çalışıyoruz. Bunlar benim için çok güzel bir faktör yani gençlerin bu konuda bizlere paylaştığı şeyler tabii ki çok güzel ve iletişim ilerlemesini sağlayan onlara ısmarladığımız bir bardak çay.”*

(K8)- *“Tanışmak istediğim kişiye çay söyleyip onu tanıyabilirim.”*

4.7.Sağlık faktörü

Genellikle sağlığa faydalı olduğunu, çok fazla olmamak kaydıyla içilmesi gerektiğini düşünen katılımcıların çoğu kişisel sağlık sorunlarına yol açarsa kendisine iyi gelmezse içmediklerini belirtmişlerdir.

(K6)- *Bildiğim kadarıyla demli çay kansızlığa sebep oluyor.Bu yüzden de mümkün olduğunca demli içmemeye çalışıyorum. Pek mide bulantısı yaptığını söylemem ama uykusuzluk yaptığını söyleyebilirim. Geç vakitte çayla kahveyi karıştırdığım zaman gerçekten uykusuzluk yapıyor ve bu yüzden akşam saatlerinde çaya biraz daha dikkat etmeye çalışıyorum.*

(K8)- *Zararları; stres, çarpıntı, kansızlık diye biliyorum. Yararlarını da kemikleri güçlendiriyormuş diye biliyorum.*

(K9)- *Bence ne faydası, ne zararı var. Çok tükettiğimiz zaman zararı olabilir az tüketildiğinde bir sıkıntı olduğunu düşünmüyorum.*

(K2)- *Çay sağlıklıdır bitkiselidir. Çay yararlıdır Rize'nin yeşillikleri Karadeniz'e de çok gittim gördüm yeşillikleri insanın içesi geliyor.*

4.8.Çay ile ilgili Sembolik Anlamlandırmalar (Arketipler, atasözleri, deyimler..)

25 katılımcının 6'sı bu konuda bir bilgisinin olmadığını ifade ederken, 19 katılımcı çeşitli bilgiler vermiştir.

(K4)- *"Çayla ilgili yeni bir deyim; Senin sesin güzeldir bize iki çay söylesene öğrendim."*

(K5)- *"Ben çayın kokusunu aldığım anda çok mutlu olurum.Çay karıştırıldığında çay kaşığının şıkırtısı insanı mutlu eder.Çayı hatırlatır.Çay denildiğinde de herkesin bildiği Çocuklar Duymasın dizisinden çaycı Hüseyin'in "Çaylarrrr" diye bağırması bizi mutlu eder."*

(K11)- *"Bir çayla birde dostla arayı açmayız."*

(K17)- *"Cemal Süreyya'dan İki çay söylerim biri açık sözünü bilirim. Çayı şiirle sembolize ederim."*

(K24)- *"Çay yapmak ve içmekte bir kültür bence. Herkes bilmiyor."*

5.SONUÇ

Çay, Türk halkı tarafından oldukça sevilen ve tüketilen bir üründür. Ancak, bu özelliklere sahip olan bir ürünün tüketimine yönelik çalışma sayısı yok denecek kadar azdır. Tüketicilerin çay tüketimleri ve eğilimlerini motivasyonel faktörler açısından inceleyen bu nitel analiz araştırmasında önemli sonuçlara ulaşılmıştır.

Görüşülen katılımcılarda, çayın; tüketim miktarının yüksek bir seviyede olduğu, tüketim şeklinin çoğunlukla sıcak ve şekerli olduğu, tüketimdeki en önemli faktörlerin keyif alma ile birlikte alışkanlık olduğu, çayla ilgili bilinen sembolik anlamların değişik ve çeşitli olduğu, sağlıklı bir içecek olarak görüldüğü, iletişime başlamada bir faktör olduğu, aile ve arkadaşlık / iş bağlantılarını pekiştirmede bir araç olarak tanımlandığı, Türk yeme-içme alışkanlıklarında öğünlerde tüketilmesinin bir adet olduğu, çoğunlukla özenle ve belirli yöntemlerle demlenerek tüketildiği, tespit edilmiştir.

Araştırmada elde edilen bilgiler çerçevesinde; çay içmenin, çayı tercih etmenin, satın alınıp talep edilmesinin kültür ve alışkanlıklarda doğrudan ilişkili olduğu belirlendiğinden çay marka işletmelerinin her türlü pazarlama faaliyetine bunu konu etmesi, birincil ilişkiler kurularak bilinirlik (marka bilinirliği gibi) sağlaması ve deneyimsel bir pazarlama yürütülmesi gerekliliği önerilebilir. Ayrıca çay ve ona bağlı ürünler (çay bardağı, tepsisi, çaydanlık vb. her türlü ürünler), Türk kültürünün anonim tasarım ürünleridir. Bu açıdan bakıldığında çay ile ilgili ya da çay satışı ile birlikte sunulacak konsept ürün ve hizmetler geliştirmenin pazarlama ve satış faaliyetlerinde yol gösterici olacağı ifade edilebilir. Bu konuda toplumsal anonim bir ürün biçiminde markalaştırılarak bir ikon haline getirilebilir. Bununla birlikte bundan sonraki çalışmalarda daha çok veri ile demografik veya coğrafik faktörlere bağlı olarak farklılıklar incelenebilir. Ya da ürün ve pazar geliştirme ya da markalar üzerine karşılaştırmalı analizler yapılabilir.

KAYNAKÇA

Çelik, F. (2006). Çay (*Camelliasinensis*); İçeriği, Sağlık Üzerindeki Koruyucu Etkisi ve Önerilen Tüketimi. *Türkiye Klinikleri Journal of Medical Sciences*, 26(6), 642-648.

Euromonitor International, *Hot Drinks in Turkey*, London: Euromonitor International Plc., 2009.

Genç, F. (2010), ‘‘ Türkiye’de Çay Üretimi ve Değişen Sosyal İlişkiler’’, T.C. Marmara Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İktisat Anabilim Dalı Kalkınma İktisadı ve İktisadi Büyüme Bilim Dalı Yayınlanmış Yüksek Lisans Tezi

Güneş, S. (2012). *Türk Çay Kültürü ve Ürünleri*. Milli Folklor, 24(94).

Harman, C. (2014). ‘‘Karadeniz Bölge'sinde Endemik Tarım Ürünleri: Fındık, Çay ve Kivi'nin Üretimi Pazarlanması ve Tüketimi’’, (Doctoral Dissertation).

Hornig, J. S., Hong, J. C., & Lin, Y. C. (2011). Innovation Strategies for Organizational Change in A Tea Restaurant Culture: A Social Behavior Perspective. *Social Behavior and Personality: An International Journal*, 39(2): 265-273.

Hürriyet. ‘‘Günde 245 Milyon Bardak Çay İçtik Türkiye’yi Dünya Lideri Yaptık’’ (16 Eylül 2010) <<http://www.hurriyet.com.tr>> (Erişim tarihi: 10.10.2018).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

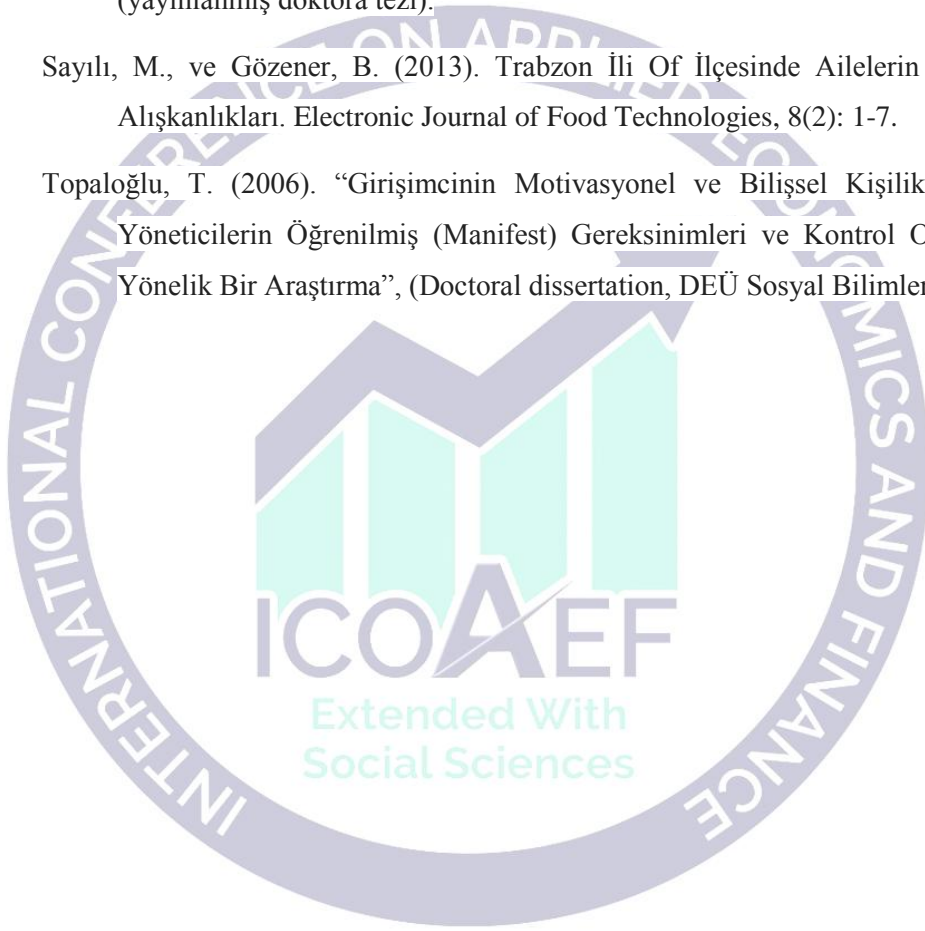
Kaya, C. Ç. ve Yalçıntaş, M. (2016). Akademisyenleri Sanayi ile İşbirliği Yapmaya Motive Eden Unsurlar-Nitel Bir Çalışma. Social Sciences, 1: 324-331.

Kılıç, O., Gündüz, O., Eryılmaz, G. A., ve Emir, M. (2012). Çay Tüketiminde Tüketici Davranışlarının Belirlenmesi: Samsun İli Örneği. Harran Tarım Ve Gıda Bilimleri Dergisi, 16(4): 19-25.

Özden, A. T. (2017). “Etnosentrik eğilim tüketicilerin satın alma davranışına etkisi: Doğu anadolu ve karadeniz bölgeleri üzerine karşılaştırılmalı analiz”.Başkent Üniversitesi, SBE, İşletme ABD, (yayınlanmış doktora tezi).

Sayılı, M., ve Gözener, B. (2013). Trabzon İli Of İlçesinde Ailelerin Çay Tüketim Durumu ve Alışkanlıkları. Electronic Journal of Food Technologies, 8(2): 1-7.

Topaloğlu, T. (2006). “Girişimcinin Motivasyonel ve Bilişsel Kişilik Özellikleri: Girişimci ve Yöneticilerin Öğrenilmiş (Manifest) Gereksinimleri ve Kontrol Odaklarının Kıyaslanmasına Yönelik Bir Araştırma”, (Doctoral dissertation, DEÜ Sosyal Bilimleri Enstitüsü).



**TÜRKİYE'DE FİNANSAL GELİŞME VE BÜYÜME İLİŞKİSİ: BOOTSTRAP
NEDENSELLİK ANALİZİ**

Selim DEMEZ*

Oktay KIZILKAYA**

Mehmet DAĞ***

ÖZET

Finansal gelişmişlik yatırımcıların ihtiyaç duydukları fonları temin etmeleri açısından büyük öneme sahiptir. Gelişmiş bir finansal sistem piyasalara işlevsellik kazandırarak ekonomik büyümeyi tetikleyecektir. Bu çalışmada 2006Q1-2018Q2 döneminde Türkiye'deki finansal gelişme ile ekonomik büyüme ilişkisi Hacker ve Hatemi-J (2012) Bootstrap nedensellik analizi ile incelenmiştir. Finansal gelişmişliği temsilen alınan değişkenlerden sadece toplam yurtiçi kredilerden ekonomik büyümeye doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi bulunmuştur. Bu sonuç Türkiye ekonomisinde finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasında arz öncüllü hipotezin geçerli olduğunu göstermektedir.

Anahtar Kelimeler: *Finansal Gelişme, Ekonomik Büyüme, Bootstrap Nedensellik Analizi*

JEL Kodları: *C32, O16, G10*

**THE RELATIONSHIP BETWEEN FINANCIAL DEVELOPMENT AND GROWTH IN
TURKEY: BOOTSTRAP CAUSALITY ANALYSIS**

ABSTRACT

Financial development is of great importance for investors to obtain the funds they need. An advanced financial system will trigger economic growth by providing functionality to markets. In this study, the relationship between financial development and economic growth in Turkey was examined by Hacker and Hatemi-J (2012) bootstrap causality analysis using 2006Q1-2018Q2 period. From total domestic loans that variables taken to represent financial development, only one-way causality relationship to economic growth was found. These results indicate that relationship between financial developments and economic growth is valid supply-leading hypothesis in Turkey.

Keywords: *Financial Development, Economic Growth, Bootstrap Causality Analysis*

JEL Codes: *C32, O16, G10*

* Dr. Öğr. Üyesi, Hakkari Üniversitesi, İ.İ.B.F., Hakkari, Türkiye, selimdemez@hakkari.edu.tr

** Dr. Öğr. Üyesi, Hakkari Üniversitesi, İ.İ.B.F., Hakkari, Türkiye, oktaykizilkaya@hakkari.edu.tr

*** Dr. Öğr. Üyesi, Siirt Üniversitesi, İ.İ.B.F., Siirt, Türkiye, mehmetdag323@gmail.com

1. GİRİŞ

Küreselleşen dünya ekonomisinde hedeflenen ekonomik büyüme rakamlarına ulaşabilmek özellikle yeterli sermaye birikimine sahip olmayan gelişmiş ve gelişmekte olan ülkeler açısından büyük öneme sahiptir. Bilindiği gibi finansal sistem fon fazlası olan birimlerden fon ihtiyacı olan birimlere fon aktarımını sağlamaktadır. Yeni finansal ürünler, finansal araçlar, işlem maliyetleri, teknolojik yenilikler gibi faktörler finansal sistemin gelişmesine ve derinleşmesine neden olmaktadır. Bu durum fon arzındaki artışı beraberinde getirmektedir. Ayrıca Finansal piyasaların ticaretin iyileştirilmesi, riskin azaltılması (hedging), portföy çeşitlendirilmesi, kaynak tahsisi, yöneticilerin izlenmesi, denetim ve tasarrufların harekete geçirilmesi gibi fonksiyonları vardır (Levine, 1999: 691).

Robinson (1952) ekonomik büyümeden kaynaklanan finansal hizmet talebinin artırmasının ekonomik büyümenin itici gücü olduğunu ileri sürmüştür (Robinson, 1952: 86). Robinson burada ekonomik büyümenin finansal gelişmeyi beraberinde getirdiğini ileri sürmektedir. Schumpeter (1911) ve Goldsmith (1969) toplam faktör verimliliği ve faktör birikimi kanallarının yatırım projelerinde iyi seçim yapılmasına olanak sağladığını belirterek ülkeler arasındaki gelişmişlik farklarının finansal kurum ve hizmetlerin kalitesiyle kısmen açıklanabileceğini belirtmişlerdir (Fung, 2009: 57).

Finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasındaki ilişki McKinnon (1973) ve Shaw (1973) tarafından ortaya konulan devletin bankacılık sistemi üzerine koyduğu yasal kısıtlamaların finansal gelişme sürecini olumsuz etkilediği ve ekonomik büyümeyi azalttığı yönündeki politika önerilerine dayanmaktadır. Benzer yaklaşım içsel büyüme modellerinde de vardır. Bu modeller finansal aracılığın ekonomik büyümeyi pozitif yönde etkilediğini belirtmektedir (Demetriades ve Dussein, 1996: 388).

Patrick (1966) finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasındaki ilişkinin arz öncüllü ve talep takipli olmak üzere iki şekilde gerçekleşebileceğini öne sürmüştür. Talep takipli ilişki, ekonomideki yatırımcılar ve tasarruf sahiplerinin finansal kurumların, varlıkların, yükümlülüklerin ve hizmetlere yönelik talebinin sonucunda finansal sistemin gelişmesidir. Bu tanımda ekonomik büyümenin sonucunda finansal sistemin harekete geçirildiğini belirtilmiştir. Arz öncüllü ilişki ise finansal kurumların, varlıkların, hizmetlerin ve yükümlülüklerin, yatırımcıların taleplerine yönelik gelişerek ekonomik büyümeyi etkilemesi olarak tanımlanmaktadır (Patric, 1966: 174-175).

2. SEÇİLMİŞ LİTERATÜR

Literatürde konu ile ilgili oldukça fazla teorik ve ampirik çalışma yer almaktadır. Tablo 1 konu ile ilgili seçilmiş ampirik çalışmaları göstermektedir. Çalışmaların tamamı finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasındaki kısa ve uzun dönemli ilişkiyi ve ilişkinin yönünü belirlemeye yöneliktir. Değişik ülke gruplarını içeren panel veri ve zaman serisi analizleri yapılmıştır. Çalışmaların neredeyse

tamamı finansal gelişmişlik ve ekonomik büyüme değişkeni olarak bu çalışmada kullanmış olduğumuz değişkenleri kullanmışlardır.

Tablo 1. Ampirik Literatür Özeti

| Yazar(lar) | Ülke(ler)-Dönem | Ekonometrik Yöntem | Sonuçlar |
|---|--|---|---|
| Atamtürk (2003) | Türkiye 1975-2003 | Granger nedensellik analizi | Finansal gelişmeden ekonomik büyümeye doğru tek yönlü nedensellik bulunmuştur. |
| Bhattacharya Sivasubramanian (2003) | Hindistan 1970,1971- 1998,1999 | Johansen eşbütünlük ve VECM Granger nedensellik analizi | Finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasında eşbütünlük ilişkisi bulunmuş ayrıca finansal gelişmeden ekonomik büyümeye tek yönlü nedensellik olduğu sonucuna varmışlardır. |
| Christopoulos ve Tsionas (2004) | 10 gelişmekte olan ülke 1970-2000 | Panel eşbütünlük, Panel nedensellik ve Johansen eşbütünlük testi | Yapılan analiz sonucunda finansal derinlik ile ekonomik büyüme arasında eşbütünlük ilişkisi olduğunu belirtmiş ayrıca finansal derinlikten ekonomik büyümeye doğru tek yönlü nedensellik ilişkisi bulunmuştur. |
| Chang ve Caudill (2005) | Tayvan 1962-1998 | VECM Granger nedensellik Analizi | Finansal gelişmeden ekonomik büyümeye tek yönlü nedensellik ilişkisi bulunmuştur. |
| Habibullah ve Eng (2006) | Gelişmekte olan 13 Asya ülkesi 1990-1998 | GMM ve panel nedensellik analizi | Finansal sektör ile ekonomik büyüme arasında güçlü bir ilişki olduğunu belirterek finansal gelişmeden ekonomik büyümeye doğru nedensellik ilişkisi olduğunu ortaya koymuştur. |
| Aslan ve Korap (2006) | Türkiye 1987Q1-2004Q4 | Johansen eşbütünlük ve Granger nedensellik analizi | Finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasında uzun dönemli bir ilişkinin bulunduğunu belirterek finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasındaki nedenselliğin değişkenlere göre değiştiğini belirtmektedir. |
| Akimov, vd. (2009) | 27 geçiş ekonomisi 1989-2004 | Dinamik ve statik panel veri analizi | Geçiş ekonomilerinde finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasında güçlü bir ilişki olduğu ortaya koyulmuştur. |
| Jenkins ve Katircioğlu (2010) | Kıbrıs 1960-2005 | ARDL sınır testi ve Granger nedensellik analizi | Finansal gelişme, ekonomik büyüme ve uluslararası ticaret arasında uzun dönemli bir ilişki olduğunu belirterek, ekonomik büyümeden finansal gelişmeye doğru bir nedensellik ilişkisi olduğu sonucuna varılmıştır. |
| Akinlo ve Egbetunde (2010) | 10 Sahra-altı Afrika ülkesi 1980-2005 | VECM Granger nedensellik analizi | Analize konu olan tüm ülkeler için uzun dönemli ilişki bulunmuştur. Ayrıca Merkez Afrika Cumh., Kongo Cumh., Gabon ve Nijerya için finansal gelişmeden ekonomik büyümeye, Zambiya için tersi durum, Kenya, Çad, Güney Afrika, Sierra Leone, Svaziland için ise çift yönlü nedensellik ilişkisi bulunmuştur. |

| | | | |
|---------------------------|--|---|--|
| Akkay (2010) | Türkiye 1989Q1-2001Q1 2001Q1-2010Q1 | Granger nedensellik analizi | Çalışmada alınan her iki ayrı dönem için de Ekonomik büyümeden finansal gelişmeye doğru nedensellik ilişkisi olduğu sonucuna varmıştır. |
| Kar vd. (2011) | 15 Orta Doğu ve Kuzey Afrika ülkesi 1980-2007 | Konya (2006) Panel Nedensellik Analizi | Finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasında net bir nedensellik ilişkisi bulunmadığını belirterek sonuçların ülkelere özgü özelliklerden dolayı değişim gösterdiğini belirtmiştir. |
| Bittencourt (2012) | 4 Latin Amerika Ülkesi 1980-2007 | Panel veri analizi | Finansal gelişme inovasyon ve ekonomik aktivite meydana getirme kanalından ekonomik büyümeyi artırmaktadır. |
| Bozoklu ve Yılancı (2013) | Seçilmiş 14 ülke 1988-2011 | Dumitrescu ve Hurlin (2012) panel Granger nedensellik analizi | Finansal gelişmeden ekonomik büyümeye nedensellik ilişkisi bulunmuştur. |
| Hsueh vd. (2013) | 10 Asya ülkesi 1980-2007 | Konya (2006) Panel Nedensellik Analizi | Finansal gelişmeden ekonomik büyümeye nedensellik ilişkisi olduğu sonucuna ulaşmışlardır. |
| Aslan ve Yılmaz (2015) | Türkiye 1980-2010 | Johansen eşbütünleşme analizi | Finansal gelişme ve ekonomik büyüme arasında eşbütünleşme ilişkisi bulunmuştur. |
| Ak vd. (2016) | Türkiye 1989-2011 | Toda-Yamamoto nedensellik analizi | Temel bileşenler analizi yöntemi ile finansal gelişme endeksi elde etmişlerdir. Ekonomik büyümeden finansal gelişmeye doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi olduğu sonucuna varmışlardır. |

Tablo 1’de görüldüğü gibi literatürdeki çalışmaların neredeyse tamamı her ne kadar finansal gelişmişlik göstergesi olarak farklı değişkenler kullanmış olsalar da finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasında uzun dönemli bir ilişki olduğunu ortaya koymaktadır. Aslında ekonomik büyüme ile finansal gelişme arasındaki ilişkinin yönü bulgu açısından çalışmaları birbirinden ayıran temel fark olarak karşımıza çıkmaktadır.

3. VERİ SETİ VE ANALİZ

Bu çalışma Türkiye için 2006Q1-2018Q2 dönemini içermektedir. Çalışmada finansal gelişme göstergesi olarak özel sektör kredilerinin GSYH’a oranı (osk) toplam yurtiçi kredilerin GSYH’a oranı (tk), M1 ve M2 parasal büyüklüklerin GSYH’a oranı, büyümeyi temsilen ise reel GSYH’ın yüzde değişimi (gdp) kullanılmıştır. Değişkenlere ait veri setleri T.C. Merkez Bankası EVDS sisteminden alınmıştır. M1 (dar para tanımı) paranın ödeme fonksiyonunu ve M2 (geniş para tanımı) paranın tasarruf fonksiyonunu yansıtır. Bu parasal göstergeler ekonomik işlemlere paralel olarak artmaktadır. Bu açıdan finansal piyasanın gerçek boyutu hakkında bilgi verebilmektedir (Kar vd., 2011:688). Khan ve Senhadji (2003) yurtiçi kredilerin GSYH’a oranının finansal gelişmişlik göstergesi olarak iyi bir gösterge olduğunu belirtmiştir. Odedokun (1989) ile Liang ve Teng (2006)’e göre toplam yurtiçi kredilerin GSYH’a oranı, finansal sektörün iç varlıklarını gösterdiğinden finansal gelişmenin bir göstergesi olarak

kabul edilebilmektedir. Ayrıca özel sektör kredileri finansal aracılık hizmetlerinin ölçümünde önemli bir veri olarak kullanılabilir.

3.1. BİRİM KÖK TESTİ

Değişkenlerin bütünsel derecelerini belirlemek amacıyla ADF birim kök testi uygulanmış ve elde edilen test değerleri Tablo 2'de sunulmuştur.

Tablo 2. ADF Birim Kök Testi Sonuçları

| Değişken | ADF Test İstatistikleri | Kritik Değerler | | |
|--------------|-------------------------|-----------------|--------|--------|
| | | (%1) | (%5) | (%10) |
| <i>gdp</i> | -3.258 [4]** | -3.584 | -2.928 | -2.602 |
| Δgdp | -4.459 [9]* | -3.610 | -2.938 | -2.607 |
| <i>osk</i> | -1.142 [0] | -3.571 | -2.922 | -2.599 |
| Δosk | -5.800 [0]* | -3.574 | -2.923 | -2.599 |
| <i>tk</i> | -1.100 [1] | -3.574 | -2.923 | -2.599 |
| Δtk | -8.723 [0]* | -3.574 | -2.923 | -2.599 |
| <i>M1</i> | -0.898 [8] | -3.600 | -2.935 | -2.605 |
| $\Delta M1$ | -4.119 [7]* | -3.600 | -2.935 | -2.605 |
| <i>M2</i> | -2.256 [0] | -3.571 | -2.922 | -2.599 |
| $\Delta M2$ | -3.458 [7]** | -3.577 | -2.925 | -2.600 |

Not: * ** ve *** sırasıyla; %1, %5 ve %10 düzeyinde anlamlılığı ifade etmektedir.

Tablo 4'den izlenebileceği gibi ADF birim kök testi sonuçlarına göre, analizde kullanılan *gdp* değişkeninin düzey değerinde durağan olduğu; diğer değişkenlerin ise düzey değerinde durağan olmadığı ve serinin birinci farkı alındığı zaman durağan hale geldiği sonucuna ulaşılmıştır.

3.2. Nedensellik Analizi

Toda-Yamamoto (1995) prosedürü gecikmesi artırılmış VAR modeline dayanmaktadır. VAR(*p*) modeli Denklem (1) ile yazılabilir;

$$y_t = v + A_1 y_{t-1} + \dots + A_p y_{t-p} + \varepsilon_t \quad (1)$$

Burada y_t , v ve ε_t n-boyutlu vektörler ve A_r ise r gecikme için parametrelerin bir $n \times n$ matrisidir. Toda ve Yamamoto (1995), bütünsel değişkenler arasındaki nedenselliği test edebilmek için kullanılacak Denklem (2) ile verilen genelleştirilmiş VAR($p + d$) modelini önermiştir.

$$y_t = \hat{v} + \hat{A}_1 y_{t-1} + \dots + \hat{A}_p y_{t-p} + \dots + \hat{A}_{p+d} y_{t-p-d} + \hat{\varepsilon}_t \quad (2)$$

Burada sürecin p gecikme uzunluğunun bilindiği varsayılmakta, d ise değişkenlerin maksimum bütünsel derecesini ifade etmektedir. Eğer aşağıda tanımlanan H_0 hipotezi reddedilemez ise y_t 'nin k . elemanı, y_t 'nin j . elemanının Granger nedeni olmadığı ifade edilir (Hacker ve Hatemi-J, 2006: 1491);

Toda-Yamamoto (1995)'nin önerdiği test istatistiğini tanımlamadan önce, örnek büyüklüğü T için aşağıdaki ifadeleri tanımlamak gerekmektedir;

$Y := (y_1, \dots, y_T)$, bir $(n \times T)$ boyutlu matris,

$\hat{D} := (\hat{v}, \hat{A}_1, \dots, \hat{A}_p, \dots, \hat{A}_{p+d})$, bir $(n \times (1 + n(p + d)))$ boyutlu matris,

$Z_t := \begin{bmatrix} 1 \\ y_t \\ y_{t-1} \\ \vdots \\ y_{t-p-d+1} \end{bmatrix}$, bir $((1 + n(p + d)) \times 1)$ boyutlu matris, $t = 1, \dots, T$ için

$Z := (Z_0, \dots, Z_{T-1})$, bir $((1 + n(p + d)) \times T)$ boyutlu matris ve

$\hat{\delta} := (\hat{\varepsilon}_1, \dots, \hat{\varepsilon}_T)$, bir $(n \times T)$ boyutlu matristir.

Bu notasyonu kullanarak, sabit terim (\hat{v}) içeren VAR($p + d$) modeli Denklem (3)'da verildiği gibi ifade edilebilir;

$$Y = \hat{D}Z + \hat{\delta} \quad (3)$$

$\hat{\delta}_U$, kısıtsız regresyondan elde edilen kalıntılar olmak üzere varyans-kovaryans matrisi $S_U = \hat{\delta}'_U \hat{\delta}_U / T$ şeklindedir. vec (column-stacking) operatör ve $0_{n \times nd}$, n satırlı ve $n(d)$ sütunlu sıfır matrisini temsil etmek üzere $\beta = vec(v, A_1, \dots, A_p, 0_{n \times nd})$ ve $\hat{\beta} = vec(\hat{D})$ olarak tanımlanabilir. Toda ve Yamamoto (1995) tarafından önerilen modifiye edilmiş Wald (MWALD) istatistiği Denklem (4)'de verildiği gibi yazılabilir;

$$MWALD = (C\hat{\beta})'[C((Z'Z)^{-1} \oplus S_U)C']^{-1}(C\hat{\beta}) \quad (4)$$

Burada \oplus Kronecker çarpımı, ve C ise $pxn(1 + n(p + d))$ boyutlu matristir. Nedensellik ilişkisinin olmadığını ifade eden sıfır hipotezi $H_0: C\hat{\beta} = 0$ şeklinde ifade edilir. MWALD test istatistiği, p 'ye eşit serbestlik derecesi sayısı ve test edilecek kısıtlamaların sayısı ile asimptotik olarak χ^2 dağılmaktadır. Hacker ve Hatemi-J (2006), çalışmalarında küçük örneklerde ki-kare dağılımı kullanıldığında test performansının zayıf olduğunu ileri sürmüşlerdir. Hacker ve Hatemi-J (2006) çalışmasının Monte Carlo simülasyon sonuçları, bootstrap dağılımına dayalı MWALD testinin, asimptotik dağılımın kullanıldığı durumlardan daha küçük boyut bozulmalara sahip olduğunu göstermektedir. Hacker ve Hatemi-J (2006) yaklaşımında, tahmin edilen VAR modeli ile gecikme uzunluğu dışsal olarak belirlenmekte, Hacker ve Hatemi-J (2012) tarafından önerilen bootstrap nedensellik testinde ise gecikme uzunluğunun içsel olarak belirlendiği durumlar araştırılmıştır. Bu

çalışmada Hacker ve Hatemi-J (2012) tarafından önerilen bootstrap nedensellik testi uygulanmış ve sonuçlar Tablo 3'te sunulmuştur.

Tablo 3. Hacker ve Hatemi-J (2012) Bootstrap Nedensellik Testi Sonuçları

| | Var (p) | MWALD Test İstatistiği | Bootstrap Kritik Değerleri | | |
|----------------------|---------|------------------------|----------------------------|-------|-------|
| | | | %1 | %5 | %10 |
| <i>osk => gdp</i> | 1 | 0.089 | 7.992 | 4.174 | 2.836 |
| <i>gdp => osk</i> | 1 | 1.002 | 8.019 | 4.131 | 2.824 |
| <i>tk => gdp</i> | 1 | 4.084** | 7.237 | 3.984 | 2.805 |
| <i>gdp => tk</i> | 1 | 2.760 | 7.345 | 4.174 | 2.795 |
| <i>M1 => gdp</i> | 2 | 0.772 | 10.758 | 6.808 | 5.134 |
| <i>gdp => M1</i> | 2 | 3.849 | 10.011 | 6.436 | 4.822 |
| <i>M2 => gdp</i> | 1 | 0.247 | 7.067 | 4.056 | 2.794 |
| <i>gdp => M2</i> | 1 | 1.644 | 7.293 | 4.051 | 2.847 |

Not: Bootstrap kritik değerleri 10.000 döngüyle elde edilmiştir. Uygun gecikme uzunluğu HJC Bilgi kriterine göre belirlenmiştir.

Tablo 3 incelendiğinde *tk* değişkeninden *gdp* değişkenine nedensellik ilişkisini gösteren MWALD istatistik değerleri, bootstrap yöntemi ile elde edilen kritik değerlerden büyük olduğundan değişkenler arasında nedensellik ilişkisinin olmadığını ifade eden sıfır hipotezi reddedilmektedir. Bu sonuçlara göre *tk* değişkeninden *gdp* değişkenine doğru nedensellik ilişkisinin olduğu tespit edilmiştir. Bu sonuç Patrick (1966) tarafından önerilen finansal sistemi oluşturan kurumların, araçların, varlıkların ve yükümlülüklerin, yatırımcıların taleplerine yönelik olarak meydana gelmesini ifade eden arz öncüllü hipotezin geçerli olduğu anlamına gelmektedir.

4. SONUÇ

Küreselleşen modern ekonomik sistemde teknolojik gelişmenin getirdiği imkanlarla birlikte yatırımcılar fon taleplerini oldukça düşük maliyetlerle finansal piyasalardan karşılama imkanına tasarruf sahipleri ise kendilerine uygun olan finansal ürünler aracılığıyla tasarruflarını değerlendirme imkanına sahip olmaktadır. Bu durum ekonomideki toplam tasarruf ve yatırımlarda artışa neden olmakta ve ekonomik büyümeyi tetiklemektedir.

Finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasındaki ilişkiye yönelik teorik çalışmalar özellikle modern büyüme teorileri ile birlikte finansal gelişmenin ekonomik büyümeyi etkilediği yönünde gelişim göstermiştir. Ampirik çalışmaların teorik literatürle aynı doğrultuda ilerlemesine karşın ilişkinin yönü hakkında kesin bir kanı ortaya koyabilmiş değildir. Bunun nedeninin çalışmaların zaman, yöntem ve örneklem bakımından farklılık göstermesinden kaynaklandığı düşünülmektedir.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Bu çalışmada finansal gelişme ile ekonomik büyüme arasındaki nedensellik ilişkisi literatürde genel kabul görmüş finansal gelişmişlik göstergeleri aracılığıyla incelenmiştir. Analize konu olan özel sektör kredilerinin GSYH'ya oranı, M1 ve M2 parasal büyüklüklerinin GSYH'a oranı ve toplam yurtiçi kredilerin GSYH'a oranı değişkenlerinden sadece toplam yurtiçi kredilerin GSYH'a oranından ekonomik büyümeye doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisine rastlanmıştır.

KAYNAKÇA

- Abu-Bader, S., & Abu-Qarn, A. S. (2008). "Financial Development and Economic Growth: Empirical Evidence from Six MENA Countries". *Review of Development Economics*, 12(4), 803-817.
- Ak, M. Z., Altıntaş, N., & Şimşek, A. S. (2016). "Türkiye'de Finansal Gelişme ve Ekonomik Büyüme İlişkisinin Nedensellik Analizi". *Doğuş Üniversitesi Dergisi*, 17 (2) 2016, 151-160.
- Akimov, A., Wijeweera, A., & Dollery, B. (2009). "Financial Development and Economic Growth: Evidence from Transition Economies". *Applied Financial Economics*, 19(12), 999-1008.
- Akinlo, A. E., & Egbetunde, T. (2010). "Financial Development and Economic Growth: The Experience of 10 Sub-Saharan African Countries Revisited". *The Review of Finance and Banking*, 2(1).
- Akkay, C. (2010). "Finansal Entegrasyon Sürecinde Finansal Gelişme Ekonomik Büyüme Arasındaki Nedenselliğin Türkiye Açısından Dönemsel Olarak Araştırılması". *Sosyal Bilimler Dergisi*, (2), 55-70.
- Aslan, N., & Yılmaz, O. (2015). "Finansal Gelişme ve Büyüme İlişkisinin Solow Modeli ile Analizi: Türkiye Üzerine Bir Çalışma". *Finansal Araştırmalar ve Çalışmalar Dergisi*, Cilt 7, Sayı 12, ss. 17-39.
- Aslan, Ö., & Korap, H. L. (2011). "Türkiye'de Finansal Gelişme Ekonomik Büyüme İlişkisi". *Sosyal ve Beşeri Bilimler Araştırmaları Dergisi*, (17).
- Atamtürk, B. (2004). "Türkiye'de Finansal Gelişme ve Ekonomik Büyümenin Nedensellik Yönü Üzerine Bir İnceleme (1975-2003)". *Maliye Araştırma Merkezi Konferansları*, (46), 99.
- Bhattacharya, P. C., & Sivasubramanian, M. N. (2003). "Financial Development and Economic Growth in India: 1970–1971 to 1998–1999". *Applied Financial Economics*, 13(12), 925-929.
- Bittencourt, M. (2012). "Financial Development and Economic Growth in Latin America: Is Schumpeter Right?". *Journal of Policy Modeling*, 34(3), 341-355.
- Bozoklu, Ş., & Yılcı, V. (2013). "Finansal Gelişme ve İktisadi Büyüme Arasındaki Nedensellik İlişkisi: Gelişmekte Olan Ekonomiler için Analiz". *Dokuz Eylül Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi* Cilt:28, Sayı: 2, ss.161-187

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Chang, T., & Caudill, S. B. (2005). "Financial Development and Economic Growth: The Case of Taiwan". *Applied Economics*, 37(12), 1329-1335.
- Christopoulos, D. K., & Tsionas, E. G. (2004). "Financial Development and Economic Growth: Evidence from Panel Unit Root and Cointegration Tests". *Journal of Development Economics*, 73(1), 55-74.
- Demetriades, P. O., & Hussein, K. A. (1996). "Does Financial Development Cause Economic Growth? Time-Series Evidence from 16 Countries". *Journal of Development Economics*, 51(2), 387-411.
- Fung, M. K. (2009). "Financial Development and Economic Growth: Convergence or Divergence?". *Journal of International Money and Finance*, 28(1), 56-67.
- Granger, Clive WJ (1969), "Investigating Causal Relations by Econometric Models and Cross-Spectral Methods", *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, 424-438.
- Habibullah, M. S., & Eng, Y. K. (2006). "Does Financial Development Cause Economic Growth? A Panel Data Dynamic Analysis for the Asian Developing Countries". *Journal of the Asia Pacific Economy*, 11(4), 377-393.
- Hacker, R. S. ve Hatemi-J, A. (2006), "Tests for Causality between Integrated Variables Using Asymptotic and Bootstrap Distributions: Theory and Application", *Applied Economics*, 38(13), 1489-1500.
- Hacker, S. ve Hatemi-J, A. (2012), "A Bootstrap Test for Causality with Endogenous Lag Length Choice: Theory and Application in Finance", *Journal of Economic Studies*, 39(2), 144-160.
- Hatemi-J, A. (2008), "Forecasting Properties of A New Method to Determine Optimal Lag Order in Stable and Unstable VAR Models", *Applied Economics Letters*, 15(4), 239-243.
- Hsueh, S. J., Hu, Y. H., & Tu, C. H. (2013). "Economic Growth and Financial Development in Asian Countries: A Bootstrap Panel Granger Causality Analysis". *Economic Modelling*, 32, 294-301.
- Jenkins, H. P., & Katircioglu, S. T. (2010). "The Bounds Test Approach for Cointegration and Causality between Financial Development, International Trade and Economic Growth: The Case of Cyprus". *Applied Economics*, 42(13), 1699-1707.
- Kar, M., Nazlıoğlu, Ş., & Ağır, H. (2011). "Financial Development and Economic Growth Nexus in the MENA Countries: Bootstrap Panel Granger Causality Analysis. *Economic Modelling*", 28(1-2), 685-693.
- Khan, M.S., Senhadji, A.S., 2003. "Financial Development and Economic Growth: A Review and New Evidence". *Journal of African Economies* 12 (supp_2), ii89–ii110.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Levine, R. (1999). "Financial Development and Economic Growth: Views and Agenda". The World Bank.

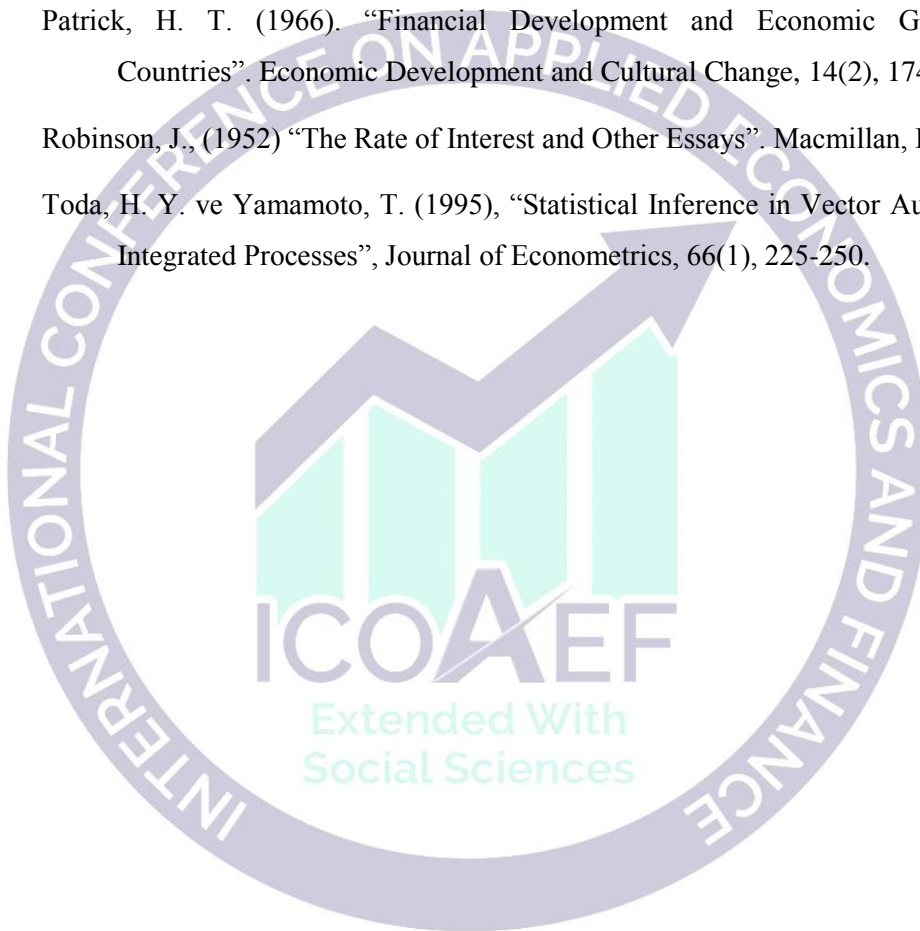
Liang, Q., & Teng J. (2006). "Financial Development and Economic Growth: Evidence from China". *China Economic Review*, 17(4), 395-411.

Odedokun, M.O., 1989. "Causalities between Financial Aggregates and Economic Activities in Nigeria: The Results from Granger's Test". *Savings and Development* 23 (1), 101–111.

Patrick, H. T. (1966). "Financial Development and Economic Growth in Underdeveloped Countries". *Economic Development and Cultural Change*, 14(2), 174-189.

Robinson, J., (1952) "The Rate of Interest and Other Essays". Macmillan, London.

Toda, H. Y. ve Yamamoto, T. (1995), "Statistical Inference in Vector Autoregressions with Possibly Integrated Processes", *Journal of Econometrics*, 66(1), 225-250.



**KKTC'DE ELEKTRONİK DEVLET SİSTEMİ YAPILANDIRMASINA YÖNELİK
VATANDAŞLARIN FARKINDALIKLARININ DEĞERLENDİRİLMESİ: LEFKOŞA İLÇESİ
ÖRNEĞİ**

Ali TATAR*

Fatma TAÇOY**

ÖZET

Gelişen bilgi ve iletişim teknolojileri ile birlikte devletler vatandaşlara sundukları hizmetlerde yenilenmeye gitmek zorunda kalmıştır. Bu yenilenmenin sonucu olarak ortaya çıkan e-devlet sayesinde hem vatandaş hem de devlet tarafından hizmet algısında kalite, verimlilik ve şeffaflık sağlanmıştır. Ancak, devlet ve vatandaş arasındaki ilişkilerde köklü değişimlere neden olan e-devlet sistemi ve hizmetlerinin yaygınlaşması ve geliştirilmesi vatandaşların algı ve farkındalık düzeylerinin artırılmasıyla mümkün olacaktır.

Bu araştırmada, Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti'nde başlatılan e-devlet sistemi ve hizmetlerine yönelik olarak vatandaşların farkındalığını ölçmek üzere Lefkoşa ilçesinde 394 kişi ile yüz yüze anket çalışması gerçekleştirilmiş ve toplanan veriler frekans dağılımları ve ki-kare bağımsızlık testi ile değerlendirilmiştir.

Çalışmada yapılan analizler; İnternete erişim, İnternet kullanım alışkanlıkları ve e-devlet uygulamalarına yönelik algı ve farkındalık arasında anlamlı ve pozitif bir ilişki olduğunu göstermektedir. E-devlet kullanımının yaygınlaştırılması için e-devlet hizmetleri ve güvenliği açısından insanların bilinçlendirilmesi ve endişelerinin giderilmesi, kurum sayfalarının güncel tutulmasının sağlanması ve İnternete ulaşımın artırılmasının kayda değer olumlu sonuçları olabileceği değerlendirilmektedir.

Anahtar Kelimeler: *E-devlet, İnternet, Lefkoşa, E-devlet projesi, KKTC*

JEL Sınıflandırması: *H54, H83, M15*

* Dr.Öğretim Üyesi, Akdeniz Karpaz Üniversitesi, Lefkoşa, KKTC, ali.tatar@akun.edu.tr.

** Yüksek Lisans Öğrencisi, Akdeniz Karpaz Üniversitesi, Lefkoşa, KKTC, fatmatacoy@yahoo.com

**EVALUATION OF AWARENESS OF THE CITIZENS FOR THE CONSTITUTION OF
ELECTRONIC STATE SYSTEM IN T.R.N.C: THE CASE OF NICOSIA DISTRICT**

ABSTRACT

Along with the development of information and communication technologies, states have been forced to renew their service systems in parallel with the developing technology. By virtue of e-government applications, quality, efficiency and transparency have been ensured in the perception of service by both citizens and the state. However, the expansion and development of the e-government system and its services, which cause radical changes in the relations between the state and the citizen, will be possible by increasing the perception and awareness levels of citizens.

For this purpose in this study; in order to measure the awareness of the citizens about the e-government system and services launched in Turkish Republic of Northern Cyprus face-to-face surveys were conducted with 394 people in the city of Nicosia, and data were evaluated by frequency distributions and chi-square independence test afterwards.

Analysis shows that there is a significant and positive relationship between Internet access, Internet usage habits and perception and awareness about e-government applications. In order to promote e-government use, it is considered that raising awareness of people in terms of e-government services and security, ensuring that the corporate pages are kept up-to-date and increasing access to the Internet may have positive results.

Key Words: *E-government, Internet, Nicosia, E-government project, TRNC*

JEL Classification: *H54, H83, M15*

1. GİRİŞ

Günümüzde devletler gelişen teknolojiye uyum sağlayarak 20 yy'in ikinci yarısından itibaren ortaya çıkan bilgi ve iletişim teknolojilerine bağlı olarak toplumlara hizmet sunma anlayışında devrim yaratacak nitelikte değişimlere gitmiştir. Bu değişim; elektronik ortamda dünyanın neresinde olursanız olun her türlü bilgiye hızlı bir şekilde ulaşma imkân sağlamıştır. Değişim sürecinin gelişmesi ile teknolojinin toplumlar için hazırlayacağı gelişmeleri tahmin etmenin zor olduğu açıkça görülmektedir.

Teknolojiye bağlı olarak gelişen dönüşüm anlayışı ile devletler, geleneksel politika anlayışından sıyrılarak dünyanın gelişimine uyum sağlama mecburiyetinde kalmıştır. Devletler küreselleşmenin de bir sonucu olarak kamu yönetim sistemlerinde merkezi yönetim anlayışı yerine bilgi ve iletişim teknolojilerine uyumlu, toplumun ihtiyaç ve beklentilerine hızlı bir dönüt sağlayabilecek yönetim

anlayışına yönlenmiştir. Kamu kurum ve kuruluşlarını uygun biçimde yeniden yapılandırma kaçınılmaz hale gelmiştir.

E-devlet sistemi, devletlerin gelişen teknolojiye bağlı olarak kamu kurumlarında merkezi yönetim sistemi yerine geliştirilmiştir. KKTC’de de e-devlet dönüşüm projesi çalışmaları başlatılmış ve aşamalar halinde işleme konmuştur. Bu çalışmada e-devlet sisteminin teorik çerçevesine bağlı olarak oluşturulan araştırma problemi ile Lefkoşa ilçesi örneklemindeki vatandaşların e-devlet konusu ile ilgili farkındalık düzeylerinin ölçülmesi hedeflenmiştir.

Gelişen teknolojinin devlet yapılarında yaptığı değişimin toplum tarafından kabul edilip kolay uygulanabilmesi ancak toplumun algısı ve farkındalığının artmasıyla mümkün olabilir. Yeni bir kamusal sistem olan e-devlet sisteminin de KKTC’de toplum tarafından ne ölçüde algılandığı bu çalışmada incelenmektedir.

2. LİTERATÜR İNCELEMESİ

2.1. E-devlet

Devletin modern çağın gereklerini karşılamada yetersiz kalmaya başlaması, eşzamanlı olarak vatandaşların beklentilerinin sürekli artması devleti büyük bir değişime mecbur bırakmıştır. Bu değişim yönetenlerin ve yönetilenlerin yepyeni kavramlarla tanışmasına sebep olmuştur (Nacar, 2008: 1). E-devlet kavramının doğuşu da bilgi ve iletişim teknolojilerinde yaşanan hızlı gelişmeler ve İnternet uygulamalarının yaygınlaşması sayesinde olmuştur. Kavrama ilişkin tanımlarda ortak nokta, “devletle ilgili işlerin elektronik ortamda yapılabilmesidir”. Bu kapsamda, e-devlet, devlet ile ilgili olarak yapılmakta olan her çeşit işlemin ve devletin vermesi gereken her türlü servis ve hizmetlerinin uygun bilişim teknolojilerinin kullanılmasıyla elektronik ortama aktarılabilmesi şeklinde ifade edilmektedir (Emiroğlu, 2003).

E-devlet, bir projeden ziyade her zaman takibinin ve denetiminin yapılması gerekli olan yeni bir yaşam biçimidir. Başka bir deyişle, e-devlet, mevcut devletin var olan bütün kurumlarıyla birlikte, teknolojik imkânlardan istifade ederek çağın gereklerine ayak uydurarak yeniden yapılandırılmasıdır (Milli emlak, 2003). Kamunun sunduğu bilgilere ulaşma imkânı, elektronik devlet kavramının yalnızca bir yüzünü oluşturmaktadır. E-devlet, vatandaşların bilgilere erişme isteklerini karşılamakla kalmadığı gibi bunun yanında kamunun sunduğu hizmetlerin elektronik yapı içerisinde görülebilmesi, vatandaşların kendileri hakkında mevcut bilgilere problemsiz ve oldukça basit bir şekilde konu ile alakalı birimlere aktarılmasını da kapsamaktadır (Mutioğlu, 2002: 962).

E-devlet, devletin vatandaşlarına karşı yerine getirmekle yükümlü olduğu görev ve hizmetlerle vatandaşların devlete karşı olan görev ve hizmetlerinin karşılıklı olarak elektronik iletişim ve işlem

ortamlarında kesintisiz ve güvenli olarak yürütülmesidir. Bu yönüyle e-devlet kavramı, bütünleşmiş strateji, süreç, organizasyon ve teknolojiyi ifade eden bir kavramdır (Çukurçayır & Eşki, 2001: 103).

Aynı zamanda kamu kuruluşları, vatandaşlar ve ticari kurumlar arasındaki bilgi, hizmet ve mal alışverişinde teknolojinin kullanılmasıyla hız, performans ve verimlilik artışı sağlanması ve giderlerin azaltılması da e-devletin hedeflerindedir (Korhan, 2004). E-devlet, kamu kurumları, yerel kuruluşlar, vatandaşlar ve işletmeler arasındaki bilgi alışverişinde, işlemlerde verimlilik, etkinlik, şeffaflık ve hesap verebilirlik sağlamak; vatandaşları bilgiye erişim ve kullanım yoluyla yetkilendirmek için kullanılmaktadır (Gökbunar ve Yanıkkaya, 2004: 147).

Tanımlamalardan da anlaşıldığı gibi e-devlet aslında devletin bir yerde “elektronikleştirilmesi” anlamına gelmektedir. Amaç, bilgilerin işlenmesi kapasiteleri artırılmış, acil kararları verebilen ve ihtiyaçları süratle cevaplandırabilen bir devlet yapısının oluşturulmasıdır. E-devlet kavramı kendi kendine meydana gelen bir kavram değildir. Zamanla artan ihtiyaçlardan kaynaklanan bilgi ve iletişim teknolojilerinin desteğiyle ayakta durabilecek yepyeni bir devlet yapılanmasının ifadesidir (İnce, 2001: 12).

2.2. E-devletin Amaçları

E-devlet oluşumunun genel amaçları; kamusal hizmetlerin yaygınlaştırılması ve erişilebilir olmasının sağlanması, hizmetlerin üretimlerinde ve yönetim süreçlerinde vatandaşların isteklerinin ve eğilimlerinin dikkate alınarak daha etkili bir biçimde değerlendirilmesi ve katılımcı yurttaşlığın önünün açılması, devlet kurum ve kuruluşlarının daha gerçekçi aynı zamanda verimliliği yüksek olarak işleminin sağlanması olarak sıralanabilir.

Ayrıca kamu yönetimlerinde şeffaflık, bürokrasi işlemlerinin azaltılması ve hızlandırılması, üretkenliklerinin ve verimliliklerinin artması, kesintisiz hizmetlerin sunulması, vatandaşların yönetimler etkin bir biçimde katılımları, herkes için eşit hizmet sunulması, etkili ve süratli denetimler yapılması da e-devletteki en temel amaçlardan bazıları olarak sayılabilmektedir.

Evren (2004)'e göre e-devlet uygulamasındaki diğer amaçlar; harcamalar üzerinde tasarruf sağlanabilmesi, kâğıt ve evrak işlemlerinin kontrol altına alınabilmesi, hizmetlerin kalitesinin artırılması, 7 gün 24 saat kamu hizmetinin verilmesi, katılımların artırılabilmesi, sade, basit, süratli ve rahat erişim imkânı şeklinde ifade edilmiştir. E-devletteki bu amaçlara zamanla daha başka amaçlarında eklenmesi söz konusudur, zira e-devlet uygulaması sürekli gelişim ve değişim içerisindedir.

2.3. KKTC'de E-devlet Uygulamaları

KKTC'de geleneksel devlet anlayışından e-devlet sistemine doğru geçiş süreci Türkiye Cumhuriyeti ile bir dizi protokol imzalanarak başlamıştır. 18.10.2016 tarihinde onaylanarak yasal hale

gelen protokol ile KKTC e-devlet projesi kapsamında kamu hizmetlerinin elektronik ortamda, ortak bir platformda ve vatandaş odaklı olarak sunumu için uygulamaların geliştirilmesi ve bütünleşmesi ile ilgili çalışmaların yürütülmesi amaçlanmıştır.

Protokol kapsamında; ihtiyaç analizi, mevcut durum tespiti, farklılık analizi ve fizibilite, projelendirme ve program yönetimi, uygulama / proje geliştirme ve devreye alma, işletim/ operasyon destek hizmetleri, bilgi ve iletişim teknolojileri alanında sürekli ve / veya süreli danışmanlık hizmetleri verilmesi yer almaktadır. (Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti Meclisi, 2016: 2)

Protokolü destekler nitelikte çeşitli yasalar (89/2007 yasa numaralı “kişisel verilerin korunması yasası”, 93/2007 yasa numaralı “elektronik imza yasası”, 6/2012 yasa numaralı “elektronik haberleşme yasası”) yayınlanarak yürürlüğe girmiştir ve ek olarak “bilgi suçları yasa tasarısı” yayınlanmıştır.

KKTC e-devlet projesi Tablo 1’de görülen fazlar çerçevesinde yürütülmektedir. Faz 1’de yer alan e-nüfus sistemi, elektronik belge yönetim sistemi (uygulama projesi), elektronik kimlik sistemi (uygulama projesi) tamamlanarak uygulamaya konulmuştur. Gümrük bilgi sistemi projesi, MEB bilgi sistemi projesi kapsamında mevcut durum ve ihtiyaç analizi çalışması yapılmış, ihtiyaçlara yönelik hedeflenen durum ortaya çıkarılmıştır (e-devlet, 2018).

Tablo 1. KKTC E-Devlet Projesi Program Aşamaları

| Fazlar | | Projeler |
|-------------|----|---|
| Faz 1 | 1 | Detaylı Mevcut Durum ve İhtiyaç Analizi |
| | 2 | E-nüfus Sistemi (Uygulama Projesi) |
| | 3 | Elektronik Belge Yönetim Sistemi (Uygulama Projesi) |
| | 4 | Elektronik Kimlik Sistemi (Uygulama Projesi) |
| Faz 2 | 5 | Gümrük Bilgi Sistemi (Analiz+Uygulama Projesi) |
| | 6 | MEB Bilgi Sistemi (Analiz+Uygulama Projesi) |
| | 7 | Şirketler Merkezi Sicil Kayıt Sistemi (Analiz+Uygulama Projesi) |
| | 8 | Mekansal Adres Kayıt Sistemi (Analiz+Uygulama Projesi) |
| Faz 3 | 9 | Sağlık Bilgi Sistemi (Analiz+Uygulama Projesi) |
| | 10 | Sigorta Bilgi Sistemi (Analiz+Uygulama Projesi) |
| | 11 | E-Devlet Kapısı |
| | 12 | Kamu Ortak Veri Merkezi (KOVM) (Analiz+Uygulama Projesi) |
| Ek Projeler | 13 | Kamu Sertifikasyon Merkezi Kurulumu (Uygulama Projesi) |
| | 14 | Kamu Sertifikasyon Merkezi İşletimi (Uygulama Projesi) |
| | 15 | KKTC Altyapı Analizi (Analiz Projesi) |
| | 16 | Kamu Yönetimi Bilgi Sistemi (Uygulama Projesi) |

Kaynak: <https://kktc.turksat.com.tr/program-organizasyonu>

E-devlet dönüşüm projesine bağlı olarak KKTC Maliye Bakanlığı bünyesinde yer alan gelir ve vergi dairesi e-devlet projesi tamamlanmıştır. Gelir ve vergi dairesi alt yapı sistemi tamamlandıktan sonra 02.05.2018 tarihinde İnternet vergi dairesi vatandaşın hizmetine açılmıştır. Vatandaşlar kurumlara gitmeden İnternet ortamında vergi işlemlerini gerçekleştirme imkânına sahiptir (Maliye Bakanlığı, 2018).

KKTC'de e-devlet dönüşüm projesi ile tüm kamu kurum ve kuruluşlarda yeniden yapılanma çalışmaları başlatılmıştır. Dönüşüm süreci henüz başında olmasına rağmen e-devlet sistemi gerekli alt yapı-donanım ve program süreçleri tamamlanarak aşamalar halinde tüm kamu birimlerinde yürütülmektedir (Uçkan, 2003: 86).

3. GEREÇ VE YÖNTEM

3.1. Araştırmanın Amacı ve Önemi

Bu çalışma e-devlet uygulamalarının Lefkoşa ilçesinde ikamet eden vatandaşlara ne ölçüde yansıdığını ve e-devlet oluşumu hakkında vatandaşların bilgi ve farkında olma düzeylerini tespit etmek amacıyla yapılmıştır.

Vatandaşların e-devlet sistemi farkındalığı konusunda arzu edilen düzeye ulaşip ulaşmadığı hakkında bir fikir sahibi olunmasını amaçlayan bu çalışmada ayrıca e-devlet sisteminin işletilmesine yönelik farkındalığın demografik değişkenler kapsamında anlamlı bir farklılık gösterip göstermediği incelenmiştir.

3.2. Araştırmanın Kapsamı ve Sınırlılıkları

Bu araştırma KKTC başkenti olan Lefkoşa ilçesi sınırları içerisinde ikamet eden nüfus üzerinde gerçekleştirilmiştir. Araştırmaya Lefkoşa ilçesinde ikamet eden toplam nüfustan 394 kişi dâhil edilmiştir. Katılımcılar basit tesadüfi örnekleme yöntemiyle seçilmiştir.

Araştırmanın konusu, Lefkoşa ilçesinde yaşayan vatandaşların e-devlet sistemine geçiş sürecinde, e-devlet sistemi ile e-devlet sistemi temelini oluşturan İnternet bilgi ve becerilerine bağlı olarak farkındalık düzeylerinin saptanması olarak sınırlandırılmıştır. Ayrıca;

* E-devlet sisteminin KKTC sınırları içerisinde yeni başlayan bir süreç olması, uygulama alanlarının kısıtlı olması,

* Gerçekleştirilen anket saha çalışmasının ekonomik ve zaman darlığı nedeniyle bir ilçede gerçekleştirilmesi,

* KKTC'nin e-devlet sistemine geçiş sürecinde e-devlet ile ilgili yasal düzenleme yetersizlikleri diğer sınırlılıklardır.

3.3. Kavramsal Model ve Hipotezler

KKTC Lefkoşa ilçesinde yaşayan vatandaşların e-devlet sistemine yönelik farkındalıklarının saptanması amacıyla nicel araştırma yöntemlerinden tarama (survey) modeli araştırma modeli olarak seçilmiştir. Araştırmada veri toplama yöntemi olarak anket yöntemi uygulanarak KKTC'de Lefkoşa ilçesinde ikamet eden vatandaşların e-devlet sistemine geçiş sürecinde e-devlet sistemi hakkındaki bilgi ve farkındalık düzeyleri ölçümü yapılmıştır. Araştırmanın hipotezleri şu şekildedir:

H₁: Katılımcıların cinsiyeti ile e-devlet sisteminden haberdar olmaları arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H₂: Katılımcıların yaşı ile e-devlet sisteminden haberdar olmaları arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H₃: Katılımcıların eğitim durumu ile e-devlet sisteminden haberdar olmaları arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H₄: Katılımcıların eğitim durumu ile kamu kurumlarından alınan hizmetleri İnternet yoluyla yapmayı tercih etme arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H₅: Katılımcıların eğitim durumu ile e-devlet konusunda bilgilendirecek bir konferansa katılımları arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H₆: Katılımcıların eğitim durumu ile İnternet kullanım becerisi arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H₇: Katılımcıların eğitim durumu ile e-devlet uygulamalarında ülkemizin geldiği konumun değerlendirilmesi arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H₈: Katılımcıların eğitim durumu ile “KKTC de e-devlet Hizmetlerinin gelişmesi arasında anlamlı bir ilişki vardır.

H₉: Katılımcıların iş durumu ile e-devlet sisteminden haberdar olma arasında anlamlı bir ilişki vardır

H₁₀: Katılımcıların iş durumu ile e-devlet sisteminden haberdar olma arasında anlamlı bir ilişki vardır.

3.4. Evren ve Örneklem

Araştırma evrenini Kuzey Kıbrıs Türk Cumhuriyeti'nde Lefkoşa ilçesinde ikamet eden vatandaşlar oluşturmaktadır. Araştırma evrenini tamamına ulaşılması zaman, maliyet ve kontrol bakımından güç olacağından dolayı örnekleme yöntemine gidilmiştir.

KKTC Yüksek Seçim Kurulundan alınan bilgiler doğrultusunda Lefkoşa ilçesinde 60,488 kişinin ikamet ettiği bilgisine ulaşılmıştır. Araştırma evreninde 60,488 kişi bulunmaktadır. Örneklem sayısının hesaplanmasında evrenini bilinen örneklemler için kullanılan örneklem hesaplama formülü kullanılmış ve araştırma evreninden %95 güven düzeyi ve %5 örnekleme hatası ile seçilmesi gereken örneklem sayısı 382 olarak bulunmuştur. Araştırmada 394 kişiye ulaşılmıştır.

3.5. Verilerin Toplanması ve Analizi

Araştırmada veri toplama aracı olarak daha önceki yüksek lisans tez çalışmalarında kullanılan örnek anket formu e-mail yoluyla izin alınarak uygulanmıştır. Verilerin toplanması bölümü iki aşamadan oluşmaktadır. Birinci aşamada bazı kurumlarda izin alınarak bazılarında araştırmacının bireysel dağıtımı ile uygulanan anket çalışmasının geliştirilmesi tamamlanmıştır. Geliştirilen araştırma anketinde toplam 22 soru ve 17 adet e-devlet uygulamaları ifadelerinden oluşturulmuştur. Literatür taranarak geliştirilen anket formunda, birinci bölümde araştırma kapsamına alınan vatandaşın; cinsiyet, yaş, eğitim durumu, iş durumu, aylık gelir bilgileri, ankete katılanların kaç yıldır Lefkoşa'da ikamet ettikleri, sorulmuştur. Ayrıca katılımcılara, e-devlet kavramıyla ilgili vatandaşların bilgi düzeylerini belirlemeye yönelik sorular yöneltilmiştir. Bu konuda bilgi sahibi olan vatandaşların, e-devlet ile birlikte kamu yönetimi anlayışında gerçekleşmesini düşündükleri beklentileri belirlemeye yönelik değerlendirmelerini tespit etmek için sorular sorulmuştur. Toplam 11 sorudan oluşan 3'lü likert tipi ölçekte (1)"Evet", (2)"Kısmen", (3)"Hayır" düzeyindeki kamu beklentileri tespit edilmeye çalışılmıştır. Buna ek olarak Lefkoşa ilçesinde e-devlet konusunda bilgi verilecek bir konferans ya da toplantı olsa vatandaşların katılım durumu ve e-devlet konusunda ülkemizdeki genel durum hakkında vatandaşların düşüncelerini ölçmeye yönelik sorular yer almaktadır. İkinci bölümde ise; araştırma veri toplama aracı olarak kullanılan anket uygulanmıştır. Katılımcılar kendilerine verilen veri toplama araçlarını yanıtlamaya başlamadan önce araştırmacı tarafından araştırmanın amacı ve ölçeğin yanıtlanması konusunda bilgilendirilmişlerdir. Araştırma verileri, araştırmacı tarafından hazırlanan anket formu ile kişilerle yüz yüze görüşülerek toplanmıştır. Sadece gönüllü olan bireylere anket çalışması uygulanmıştır.

Soru formundan elde edilen verilerin istatistiksel çözümlemesinde Statistical Package for Social Science (SPSS) 24 istatistiksel veri analizi paket programı kullanılmıştır.

Anketin birinci bölümünde; katılımcıların sosyo-demografik özelliklerinin dağılımını tespit etmek amacıyla frekans analizi kullanılmış ve sonuçlar frekans dağılım tabloları ile gösterilmiştir. Anket formunun ikinci bölümünde katılımcıların İnternet bilgisi ve İnternet kullanımına yönelik görüşlerin

belirlenmesi ve e-devlet sistemi farkındalığının saptanması amacıyla sorular hazırlanmıştır. Oluşturulan sorularla katılımcıların İnternet bağlantısına sahip olma durumları, İnternete daha çok nereden bağlandıkları ve bağlanma amaçları, Lefkoşa ilçesindeki herhangi bir kamu web sitesini ziyaret edip etmedikleri ilgilidir. Katılımcıların İnternet kullanma durumlarını tespit etmek amacıyla frekans analizi kullanılmıştır. Anketin üçüncü bölümünde araştırma katılımcılarına e-devlet konusu hakkındaki farkındalıklarını ölçmeye yönelik sorular yöneltilmiştir. Bu bağlamda; vatandaşlara e-devlet kavramı konusunda ve elektronik devletle birlikte kamu hizmetlerinin sunulmasında gerçekleşmesini düşündükleri beklentilerini belirlemeye yönelik sorular sorulmuştur. Ankette yer alan sorular ile Lefkoşa ilçesindeki vatandaşların İnternet ve e-devlet kavramına ilişkin bilgileri, Lefkoşa ilçesinde İnternete erişimin daha kolay hale getirilmesi için öncelikli olarak neler yapılabileceği, ülkemizde e-devlet hizmetlerinin gelişmesi için neler yapılabileceği ve e-devlet kavramına dair vatandaşların ne düzeyde farkındalığa sahip oldukları ayrıca bu kavramla ilgili olumlu ya da olumsuz düşünceleri tespit edilmek istenmiştir. Bu bağlamda araştırma kapsamında varsayımlar oluşturulmuştur ve bu varsayımlar birbirinden bağımsız değişkenler olduklarından ötürü, oluşturulan varsayımlar ki-kare bağımsızlık testi ile analiz edilmiştir.

4. BULGULAR

4.1. Araştırmaya Katılanların Demografik Özellik Dağılımları

Araştırmaya katılan katılımcıların demografik özelliklerini belirlemek amacıyla cinsiyet, yaş, eğitim düzeyi, iş durumu, aylık ortalama, gelir düzeyi ve Lefkoşa ilçesinde ikamet ettikleri süreye ilişkin toplam 6 soru yöneltilmiştir. Katılımcıların;

* %48,5'i erkek, %51,5'inin kadın olduğu,

* %14,2'si, 20 yaşından az, %17'si 21-30 yaş arası, %21,1'i 31-40 yaş arası, %21,8'i 41-50 yaş arası, %14'ü 51-60 yaş arası, %11,9'u 61 yaş aralığında olduğu,

* %16'sı ilköğretim, %21,6'sı ortaöğretim, %17,3'ü ön lisans, %27,4'ü lisans, %17,8'i yüksek lisans mezunu olduğu,

* %11,7'sinin 1000 TL'den az, %17'sinin 1001-2000 TL, %19,5'inin 2001-3000 TL, %22,8'inin 3001-4000 ve %28,9'ünün 4000 TL ve üzeri aylık ortalama gelire sahip olduğu,

* %39,6'sının memur (devlet memuru, polis vb.), %18,5'inin özel sektör (devlet harici özel şahıs veya ortaklık kurumlarında çalışanlar), %19,3'ünün serbest meslek sahibi (esnaf vb.), %14,2'sinin öğrenci, %8,4'ünün ev hanımı olduğu,

* %19'u 0-5 yıl arası, %15,5'i 6-10 yıl arası, %24,1'i 11-20 yıl arası, %20,1'i 20-30 yıl arası, %21,3'ü 30 yıl ve üzeri Lefkoşa ilçesinde ikamet ettiği belirlenmiştir.

4.2. Katılımcıların İnternet Bilgi Düzeylerine ve İnternet Kullanım Amaçlarına İlişkin Dağılımları

4.2.1. Katılımcıların İnternet Kullanım Bilgi ve Becerisi Durumuna Göre Dağılımı

Araştırmaya katılan katılımcıların İnternet kullanımı hakkında bilgi ve beceri sahibi olma düzeylerini belirleme amacıyla veriler değerlendirildiğinde; katılımcıların %62,7'si yeterli bilgi ve beceriye sahip olduğunu, %37,3'ü ise sahip olmadığını belirtmiştir. Verilere göre vatandaşların İnternet kullanım bilgi ve becerisi yüksek olduğunu ve e-devlet sistemi İnternet ortamında rahatlıkla kullanabilecekleri söylenebilir.

4.2.2 İnternet Bağlantısı Sahipliğine Göre Dağılım

Araştırmaya katılım gösterenlerin %59,1'inin evinde/işyerinde İnternet bağlantısı olduğu; %40,9'unun ise evinde/işyerinde İnternet bağlantısı olmadığı belirlenmiştir. Elde edilen bu sonuç katılımcıların çoğunluğunun İnternete kolay erişim imkânının bulunduğunu göstermektedir. Vatandaşların İnternete bağlantı sahipliği durumunun yüksek olması e-devlet hizmetlerine İnternet ortamında kolay erişim sağlayabileceklerini göstermiştir.

4.2.3. İnternete Bağlanma Yerine Göre Dağılım

Araştırmaya katılan katılımcıların İnternet bağlanma yerine göre dağılımları incelendiğinde; evden bağlananlar %24,4 iken; iş yerinden bağlandığını ifade edenlerin oranı %29,7, mobil telefondan bağlandığını belirtenlerin oranı %28,2 İnternet kafeden bağlandığını belirtenlerin oranı %17,8 olduğu belirlenmiştir.

4.2.4. İnternete Bağlanma Amaçlarına Göre Dağılım

İnternete bağlanma amaçlarına göre dağılım bulguları Tablo 2'de gösterilmiştir. Katılımcıların %39,1'i İnterneti bilgi edinme, akademik araştırma, haber, gazete okuma gibi amaçlarla kullandığını belirtmiştir. Katılımcılardan % 59,1'i İnterneti iletişim (Msn, Facebook, Twitter, Whatsapp) amaçlı kullandıklarını ifade ederken, %40,9'u bu amaçla kullanmadığını belirtmiştir. Katılımcıların İnterneti iletişim amaçlı kullanma oranının yüksek olması bilgi ve iletişim teknolojilerini yakından takip edildiğinin ve sosyal iletişime ne kadar önem verildiğinin bir göstergesi olduğu ifade edilebilir. Elektronik ortamda sunulan kamu hizmetlerinden (e-kimlik, araç-kayıt vb.) yararlanmada ise katılımcıların %59,4'ü bu amaçla İnterneti kullandığını belirtirken, %40,6'lık orana sahip olan grubun kullanmadığı belirlenmiştir. Katılımcıların İnterneti alışveriş, çevrimiçi bankacılık ve ticari işlemler için kullanım oranından da anlaşılacağı gibi; katılımcıların %71,7 'si bu ifadeye katılım göstermiştir. Ayrıca katılımcıların İnterneti alışveriş çevrimiçi bankacılık ve ticari işlemler için kullanma amacı %55,1 olduğu belirlenmiştir.

Tablo 2. Katılımcıların İnternete Bağlanma Amaçlarına Göre Dağılımları

| Araştırma İfadeleri | Yargı | Frekans (N=394) | Yüzde |
|--|-------|--------------------|-------|
| İnterneti bilgi edinme, akademik araştırma vb. konular için kullanım | Evet | 154 | 39,1 |
| | Hayır | 240 | 60,9 |
| İnterneti kamu hizmetlerinden (e-kimlik, araç-kayıt vb.) faydalanmak için kullanım | Evet | 234 | 59,4 |
| | Hayır | 160 | 40,6 |
| İnterneti iletişim (msn, facebook, twitter, whatsapp) için kullanım. | Evet | 233 | 59,1 |
| | Hayır | 161 | 40,9 |
| İnterneti çevrimiçi oyunlar için kullanım. | Evet | 216 | 54,8 |
| | Hayır | 178 | 45,2 |
| İnterneti alışveriş, çevrimiçi bankacılık ve ticari işlemler için kullanım | Evet | 217 | 55,1 |
| | Hayır | 177 | 44,9 |

4.2.5. Lefkoşa İlçesindeki Kamu Kurumlarının Web Sitelerinden İşlem Yapıp Yapmayan Katılımcılara İlişkin Dağılımlar

Katılımcıların %56,3'ü Lefkoşa ilçesindeki kamu kurumlarından alacağı hizmetleri İnternet yoluyla gerçekleştirmeyi tercih ettiğini belirtirken, %43,7'si tercih etmediğini belirtmiştir.

Katılımcıların İnternet yoluyla sunulan kamu hizmetlerinden yararlanmama sebeplerine ilişkin bulgularda şu sonuçlar ortaya çıkmıştır. Katılımcıların; % 20,3'ü İnternet üzerinden işlem yapmayı güvenilir bulmadığını, %22,8'i bizzat kamu kuruluşuna gitmeyi tercih ettiğini, %18,5'i kamu kurumlarının hizmet sunduğu sayfalarda güncel bulmadığını, %18,3'ü böyle bir hizmetten haberdar olmadığını, %20,1'i ise İnternete ulaşma imkânı olmadığı için kullanmadığını belirtmiştir. Bu bulgular; vatandaşların İnternet ortamında gerçekleştirilen kamusal hizmet işlemlerine güven eksikliği duyduğu, ayrıca vatandaşların alışkanlıklarından kolay vazgeçemediği söylenebilir. Sebep olmaksızın katılımcıların %22,8'i hizmet sunulan kamu kurumlarına bizzat gitmeyi tercih ettiğini ifade etmiştir.

Toplumda yer alan tüm bireylerin eşit koşullarda eşit şartlarda İnternete ulaşımı söz konusu olmamaktadır. Bu bağlamda Lefkoşa ilçesinde katılımcıların İnternete erişimi kolaylaştırmaya yönelik

olarak nelerin yapılabileceğini saptamak amacıyla Tablo 3'te yer alan ifadeler yer verilmiştir. Katılımcıların %24,9'u Lefkoşa'daki İnternete uzaktan erişim (wi-fi, wireless, bluetooth vb.) alanlarının genişletilmelidir." ifadesine daha fazla katılım gösterdikleri, ayrıca %21,6'sının Lefkoşa'nın merkezi yerlerine, halkın İnternete kolay ulaşımını sağlayacak bilgisayar odaları kurulmalıdır." ifadesine katıldığı belirlenmiştir. %20,1'lik kısmın da "İnternete erişim için halka İnternet kullanımı konulu konferans seminer vb. düzenlenmelidir." ifadesine katılım gösterdiği görülmüştür.

Tablo 3. Katılımcıların Lefkoşa İlçesinde Her Bireyin İnternete Erişimini Kolaylaştırmak İçin Yapılması Gerekenlere Göre Dağılımları

| İnternete erişim imkânını arttırabilmek için sizce aşağıdakilerden hangisi öncelikli olarak gerçekleştirilmelidir? | Kişi Sayısı | Yüzde (%) |
|---|--------------------|------------------|
| Kişisel bilgisayarı olmayan için, kamu kuruluşları içinde ücretsiz İnternet büfeleri kurulmalı. | 57 | 14,5 |
| Şehrin merkezi yerlerine, halkın İnternet kolay ulaşımını sağlayacak bilgisayar merkezleri kurulmalı. | 85 | 21,6 |
| İnternete uzaktan erişim (wi-fi wireless bluetooth vb.) alanları genişletilmeli. | 98 | 24,9 |
| İnternet kullanımı konulu konferans seminer vb. düzenlenmeli. | 79 | 20,1 |
| Fikrim yok. | 75 | 19,0 |
| Toplam | 394 | 100,0 |

4.3. Lefkoşa İlçesindeki Vatandaşların e-devlet Sistemi Oluşumu Farkındalığına İlişkin Bulgular

Araştırmacı tarafından oluşturulan e-devlet ifadelerine yönelik bulgular incelendiğinde; katılımcıların %55,6'lık oranı e-devlet kavramından haberdar olduğu, %44,4'ünün kavramdan habersiz olduğu belirlenmiştir.

E-devlet kavramı ile ilgili bilgi sahibi olan ya da olmayan tüm katılımcılara yöneltilen "Halkı e-devlet konusunda bilgilendirecek bir toplantısı olsa katılır mısınız?" sorusuna; katılımcı grubunun %58,1'lik kısmının olumlu cevap verdiği tespit edilmiştir. Bu oran e-devlet kavramı hakkında bilgi sahibi olmayanlarında katılımın toplamı olarak ortaya çıkmıştır. Bu oranın yüksek olması katılımcıların e-devlet uygulamaları ile ilgili yapılacak olan çalışmalara karşı olumlu bir tutum içerisinde olduklarının göstergesidir-devlet konusunda topluma yönelik olarak yapılacak tanıtım çalışmaları ile e-devlet sürecinde önemli ilerlemelerin sağlanabileceği sonucuna varabiliriz. %41,9'luk kesim ise e-devlet

konusunda yapılacak bilgilendirme toplantısına katılmayacağını belirtmiştir. Olumsuz cevap veren katılımcılar işlemlerini kamu kurumlarına giderek yapmayı tercih ettiğini belirtmişlerdir.

Tablo 4.7 Katılımcıların E-Devlet Bilgilendirme Faaliyetlerine Katılım Oranlarına Göre Dağılımları

| Lefkoşa' da sizi E-devlet konusunda bilgilendirecek bir konferans ya da seminer olsa gider misiniz? | Kişi Sayısı | Yüzde (%) |
|--|--------------------|------------------|
| Evet | 229 | 58,1 |
| Hayır | 165 | 41,9 |
| Toplam | 394 | 100,0 |

4.3.1. E-devlet Sistemi Oluşumuna İlişkin Beklentiler

E-devlet sistemi oluşumuna ilişkin veriler incelendiğinde katılımcıların %45,2'si elektronik devletin kamu hizmetlerinin daha hızlı sunulmasına katkı sağlayacağını, %46,2'si kamu kurularında gerçekleştirilen işlemlerin maliyetlerinin düşeceğini, %46,2'si kamu hizmetlerinin yerine getirilmesinde gereksiz formalitelerin (kâğıt işlerinin) azalacağını, %46,4'ü kamu hizmetlerinin daha verimli hale geleceğini ifade etmiştir. Katılımcılar kamu kurumlarında e-devlet hizmetleri tüm olanaklarıyla gerçekleştirilip sunulduğunda “Kamu hizmetlerinin mesai saatlerine bağımlılığı ortadan kalkar” ifadesine %41,1'lük oranla olumlu yönde katılım sağlarken %32,7'lik oran olumsuz yönde, %25,9'lük oranda ise kısmen katılım sağlamıştır. Kurumlarda adam kayırmaların (torpilin) önüne geçilir” ifadesine katılımcılar %42,4 oranıyla katılım gösterirken, %23,9'lük orana sahip katılımcı grubu adam kayırmaların kısmen önlenebileceğini belirtmiştir. %33,8'lik kesim ise kamu hizmetlerinin temel sorunlarından olan adam kayırmaların önlenemeyeceğini, e-devlet oluşumunun da bu soruna çare olamayacağını ifade etmişlerdir. Kamu kurumlarında tam olarak sunulduğunda e-devlet hizmetlerinin sağlayabileceği yararlarla ilişkin olarak katılımcıların %41,9'u Kamu hizmetlerine aracısız erişim mümkün hale gelir ifadesine olumlu yönde katılım sağlamıştır.% 31,5'i bu ifadeye katılmazken % 26,6'sı bu ifadeye kısmen katılmıştır. Katılımcılar e-devlet sisteminin gelişmesiyle kamu hizmetlerine aracısız olarak erişime olumlu yönde ortalama değerinde katılım sağlamıştır. Bunun en önemli nedeni katılımcıların alışkanlıklarından vazgeçmeyerek işlemlerini kamu kurumlarında görev alan kamu görevlilerine yaptırmak istemelerinden dolayı kaynaklanabilmektedir. Bunun yanı sıra katılımcılar %32,2'si sunulan hizmetlerin vatandaşların istek ve beklentilerine göre belirlenebileceğini, kamu

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

hizmetlerindeki değişimler açısından vatandaşların %38,8'i daha katılımcı bir yönetim ve hizmet sunma anlayışı oluşacağını, %41,6'sı de kamu hizmetlerinin daha kaliteli sunulabileceğini ifade etmiştir.

Araştırmaya katılan katılımcılara yöneltilen e-devlet uygulamalarındaki ülkenin konumuna ilişkin ifadelerle %25,4 'lük orana sahip olan grup uygulamaların gelişim sürecinde olduğu görüşüne katılım göstermiştir. Katılımcılar %21,6'lık oranda ise uygulamaların yetersiz olduğunu , %17,5 oranında işlevsel olmayıp tanıtım amaçlı kullanıldığını; %21,3 oranında ise uygulamalar hakkında fikirlerinin olmadığını, %14,2 oranında uygulamaların oldukça iyi olduğu yönünde katılım göstermişlerdir. Sonuçlardan yola çıkarak vatandaşların e-devlet uygulamalarının gelişim sürecinde olduğu fikirde bütünleştiğini ve e-devlet uygulamalarını yeterli bulmadıkları söylenebilir.

KKTC'de e-devlet hizmetlerinin gelişmesinin ne gibi etkenlere bağlı olduğuna dair yöneltilen soruya %24,1'i e-devlet hizmetlerinin gelişmesini yöneticilerin e-devlet uygulamalarını desteklemesine bağlı olduğunu belirtirken, %21,1 oranlık kısım teknolojinin getirdiği kolaylıklara bağlı olduğunu belirtmiştir. Ayrıca katılımcılar ilgili ifadeye %17,8 oranında fikirlerinin olmadığı saptanmıştır. İlgili ifadenin verilerine göre katılımcılar gelişmedeki en önemli etkeni "yöneticilerin iradesi" olduğunu düşünmektedirler. Bu durumla yöneticilerin e-devlet sistemine yönelik olumlu bir tutum sergilemesi vatandaşların e-devlet konusundaki görüşlerine de olumlu yönde bir katkı koyacağını yansıtmıştır denilebilir. Ayrıca katılımcıların %18,3'ü çalışanların teknolojiye olan hevesine bağlıdır ifadesine katılım gösterirken geriye kalan %18,8'lik kısımda e-devlet gelişiminin AB uyum yasalarına bağlı olacağı kanaatindedir.

Ülkedeki e-devlet gelişiminin önündeki en önemli engelle ilişkin yöneltilen soruya; katılımcılar bürokratik engeller ve alışkanlıklar ifadelerine %22,8 oranla ortak katılım göstermişlerdir. Bu ifadelerin ardından katılımcılar e-devlet gelişiminin engelleyen diğer bir engelin çevrimiçi işlemlere olan güvensizlik olarak %17,5 oranında katılım göstermiştir. Ayrıca katılımcıların %18,5'i mali yetersizlikleri e-devlet gelişimin önündeki engel olarak değerlendirirken % 19,8 oranının da konu ile ilgili fikirlerinin bulunmadıkları hakkında görüş bildirmiştir.

Tablo 5. Katılımcıların KKTC’de e-devlet gelişiminin önündeki en önemli engel ifadelerine katılım durumlarına ilişkin dağılımları

| KKTC’de sizce E-devletin gelişmesini engelleyen en büyük engel nedir? | Kişi Sayısı | Yüzde (%) |
|--|--------------------|------------------|
| Bürokratik engeller | 90 | 22,8 |
| Alışkanlıklarımız | 84 | 21,3 |
| Online işlemlere duyulan güvensizlik | 69 | 17,5 |
| Mali yetersizlikler | 73 | 18,5 |
| Fikrim yok | 78 | 19,8 |
| Toplam | 394 | 100,0 |

Katılımcılardan; KKTC’de e-devlete geçiş için öncelikli olarak izlenmesi gereken en önemli adım olarak %30,5’lik oranla teknolojik alt-yapı ve donanımın geliştirilmesi ifadesine katılım göstermişlerdir. Bu oranının yüksek olması katılımcıların ülkedeki teknolojik alt yapı donanımının yeterli düzeyde olmadığını düşündüklerini yansıtmaktadır. %15,2’lik paya sahip grup ise kanun kontrollü dönüşümün temel alınması gerektiğini ifade etmiştir. Katılımcılardan başarılı ülke uygulamalarının örnek alınması gerektiği ifadesine %18,8 katılım göstermiştir. %17,8’lik kesim ise her kurumun kendi serbest ortamında dönüşümünü gerçekleştirmesinin mümkün olabileceğini belirtmiştir. Katılımcıların %17,8’i ise konu ile ilgili fikirlerinin olmadığını ifade etmişlerdir.

4.4. Araştırma Varsayımlarına İlişkin Bulgular

Araştırma kapsamında anketin üçüncü bölüme ilişkin olarak oluşturulan varsayımlar, birbirinden bağımsız değişkenler olduklarından doğruluklarının test edilmesi maksadıyla ki-kare bağımsızlık testi ile analiz edilmiştir. Bulgulara bakıldığında özetle;

* Katılımcıların “cinsiyeti”, “yaşı”, “eğitim durumu”, “iş durumu” ile “e-devlet kavramından haberdar olmaları” arasında anlamlı bir ilişki olduğu,

* Katılımcıların “eğitim durumu” ile “kamu kurumlarından alınan hizmetleri İnternet yoluyla yapmayı tercih etme”, “e-devlet konusunda bilgilendirici konferansa katılma” ve “KKTC’de e-devlet hizmetlerinin gelişmesi” hususları arasında anlamlı bir ilişki bulunmadığı,

* Katılımcıların “eğitim durumu” ile “e-devlet uygulamalarında KKTC'nin geldiği konumun değerlendirilmesi” arasında anlamlı bir ilişki olduğu sonuçlarına varılmıştır.

5. TARTIŞMA VE SONUÇ

İlçede çoğunluğun İnternet kullanımını hakkında bilgi ve beceri sahibi olduğu, bu nedenle kullanıcı dostu e-devlet sistemini rahatlıkla kullanabilecekleri söylenebilir. Benzer oranın İnternete kolay erişim için de söz konusu olduğu değerlendirildiğinde imkân ve beceri açısından e-devlet kullanımını potansiyelinin yüksek olduğu görülmektedir. E-devlet kullanımının artırılması için anılan konularda kısıtlı bulunanlara odaklanmak fayda sağlayabilecektir.

İnterneti ihtiyaçlarını karşılamak üzere kullanan gruplara bakıldığında (iletişim, alışveriş-bankacılık, kamu işleri) bunların oranlarının çok yakın olduğu görülmektedir (%55-60 arası). Bu durum da İnterneti ihtiyaçlarını karşılamak için kullanma alışkanlığının, e-devlet kullanımını artıracak izlenimi doğurmaktadır. E-devlet kullanımının artırılması için İnternet kullanımını alışkanlığının teşvik edilmesinin fayda sağlayabileceği görülmektedir. Ayrıca, kamu hizmetlerini İnternette yapmayı tercih etmeyen kesimin öne sürdüğü sebepler güvenli bulmama, sayfaların güncel olmaması, bu hizmetten haberdar olunmaması ve İnternete ulaşma imkânlarının olmaması sebepleri ortadan kaldırılarak, e-devlet kullanımını doğrudan artırılabilir.

Katılanların %22,8'i ise sebep olmaksızın kamu kuruluşuna gitmeyi tercih etmektedir. O halde bu sebeplerin ortadan kaldırılması, bununla birlikte sebep sunmaksızın kamu kurumlarına gitmeyi tercih edenlerin bunu tercih sebeplerinin ve e-devlet kullanımının bu grupta nasıl yaygınlaştırılabileceğinin tespiti, bu çalışma kapsamı dışında kaldığından, ayrı bir çalışma yapılmasına ihtiyaç göstermektedir.

Katılımcılara İnternet ulaşımının iyileştirilmesine yönelik sorulan sorulardan, İnternete uzaktan erişim alanlarının genişletilmesi, merkezi alanlara bilgisayar odaları kurulması, kişisel bilgisayarı olmayanlar için İnternet büfelerinin kurulması ve halka İnternet kullanımını konusunda bilgi verilmesi gibi çözümlere katılım göstermişlerdir. Bahse konu çözümlere katılım oranlarının yaklaşık aynı olduğu göz önünde bulundurulduğunda, halkın, bu çözüm yollarının tamamını benzer oranda kullanacağı, bu nedenle bahse konu çözümlerin tamamının uygulamaya konulmasının çözüme katkı sağlayacağı sonucuna varılmaktadır.

Anket sonuçlarına göre e-devlet uygulamalarının, büyük çoğunluğun (%85,8) beklentilerini karşılayacak düzeyde olmadığı anlaşılmaktadır. Bu durum da, e-devlet kullanım oranını düşürebilecek bir husustur. Bu nedenle bu çoğunluğun beklentilerine yanıt verecek şekilde uygulamaların iyileştirilmesi önem arz etmektedir.

Katılımcıların, e-devlet gelişiminin hangi etkenlere bağlı olduğu ve gelişimin önündeki engellere yönelik cevaplarına bakıldığında, büyük çoğunluğun insan faktörüne bağlı cevaplar (çalışanların

teknolojiye hevesi, yöneticilerin desteği, bürokratik engeller ve alışkanlıklar, çevrimiçi işlemlere güvensizlik) olduğu görülmektedir. Buna karşın, e-devlete geçiş için izlenmesi gereken öncelikli adıma en yüksek oranda teknolojik alt yapı ve donanımın geliştirilmesi cevabı verilmiştir. Bu durumda, teknolojik alt yapının geliştirilmesi ile insan faktörüne yönelik tedbirlerin aynı anda gerçekleştirilmesinin önem arz ettiği görülmektedir.

Katılımcıların “cinsiyeti”, “yaşı”, “eğitim durumu”, “iş durumu” ile “e-devlet Kavramından haberdar olmaları” arasında anlamlı bir ilişki varken, katılımcıların “eğitim durumu” ile “kamu kurumlarından alınan hizmetleri İnternet yoluyla yapmayı tercih etme”, “e-devlet konusunda bilgilendirici konferansa katılma” ve “KKTC de e-devlet hizmetlerinin gelişmesi” hususları arasında anlamlı bir ilişki bulunmadığı sonuçlarına varılmıştır. Bu durumda, katılımcıların farkındalıklarını artırmak açısından yalnızca “e-devlet kavramından haberdar olmaları” hususunun ilgili değişkenlerle etki altına alınabileceği (iyileştirilebileceği) sonucu ortaya çıkmaktadır.

E-devlet kullanımının yaygınlaştırılması için öncelikle e-devlet hizmetleri ve güvenliği açısından insanları bilinçlendirmek ve endişelerini gidermek, bununla birlikte sayfaların güncel tutulmasını sağlamak üzere çalışma yapılması uygun olacaktır. İkinci olarak, İnternete ulaşımın artırılması, e-devleti kullanamayan %20,1’lik bir grubu kullanıcı kitlesine dâhil edecektir. Son olarak, hiçbir sebep belirtmeksizin kamu kurumlarına gitmeyi tercih edenlerin, bunu tercih etme sebepleri (alışkanlık, tutum vs.) tespit edilerek e-devlet kullanımının bu grupta nasıl yaygınlaştırılabileceğinin belirlenmesi için yeni bir çalışma yapılmasına ihtiyaç olduğu değerlendirilmektedir.

KAYNAKÇA

Çukurçayır , A., & Eşki, H. (2001). Kamu Hizmeti Sunumunda Yeni Yöntemler. S.Ü. İİBF Sosyal ve Ekonomik Araştırmalar Dergisi(1-2).

E-devlet E-devlet dönüşüm projesi: <https://kktc.turksat.com.tr/> .(20.04.2018)

Emiroğlu, B. G. (2003). E-devlet: Yapıları Durumu, Sunulan Servisler Dünyada Gerçekleştirilen Uygulamalar, Türkiye’deki Çalışmalar ve Model Önerisi. XII. “Türkiye’de İnternet” Konferansı. Ankara.

Gökbunar, R., & Yanıkkaya, H. (2004). Etkin Devlet ve Ekonomik Gelişme. Ankara: Odak.

İnce, N. (2001). Elektronik Devlet: Kamu Hizmetlerinin Sunulmasında Yeni İmkanlar. DPT Yayını.

Korhan, M. (2004). Türkiye’de Elektronik Devlet Hizmetlerinin Tanıtım Çalışmaları Üzerine Bir İnceleme. (Yayımlanmamış Yüksek Lisans Tezi) İstanbul: İstanbul Üniversitesi, SBE.

KKTC. , (2017) . KKTC: https://online-vergi.gov.ct.tr/gvdos_online-vergi/ (20.03.2018).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Maliye Bakanlığı. (tarih yok). 05 02, 2018 tarihinde İnternet vergi dairesi: https://online-vergi.gov.ct.tr/gvdos_online-vergi/ (20.03.2018).

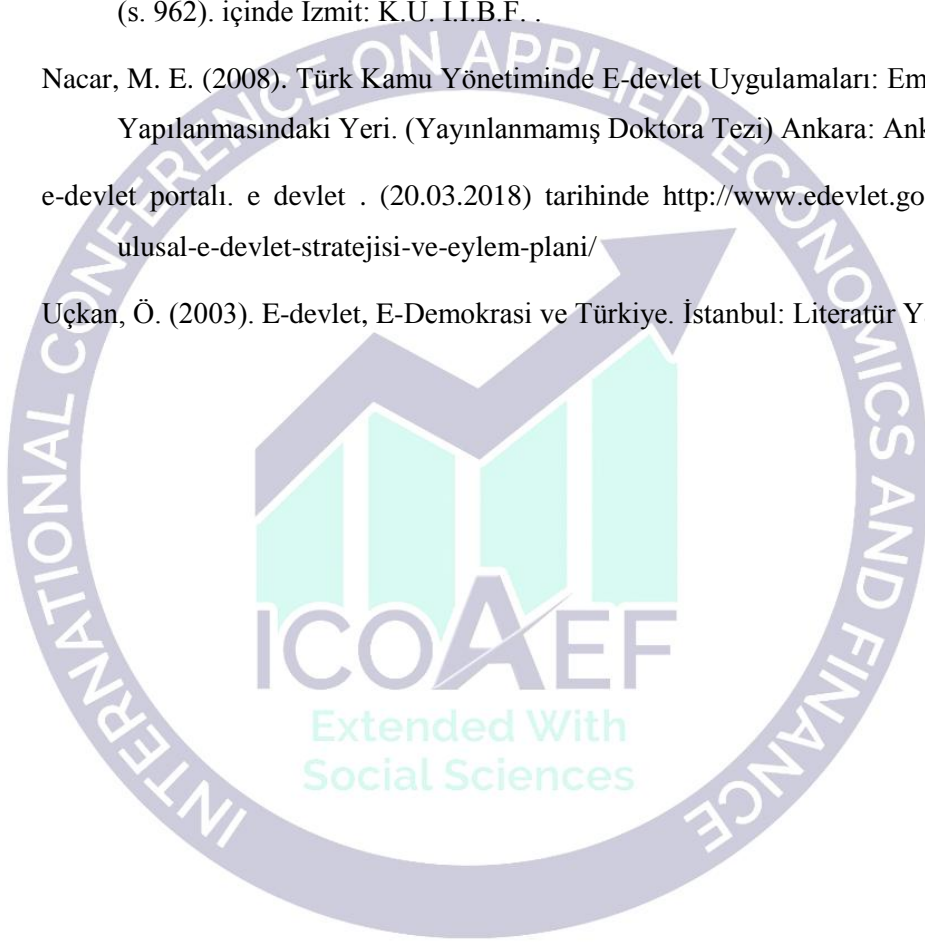
KKTC Meclisi. (2016). E-devlet Projesinin Yürütülmesine İlişkin Protokolün Onaylanmasının Uygun Bulunmasına İlişkin (Onay) Yasa Tasarısı : www.cm.gov.nc.tr/Yasalar/e-devlet.pdf, (28.03.2018).

Mutioglu, H. (2002). Küreselleşme ve E-(tik) Devlet . I. Ulusal Bilgi, Ekonomi ve Yönetim Kongresi (s. 962). içinde İzmit: K.Ü. İ.İ.B.F. .

Nacar, M. E. (2008). Türk Kamu Yönetiminde E-devlet Uygulamaları: Emniyet Teşkilatı'nın E-devlet Yapılanmasındaki Yeri. (Yayınlanmamış Doktora Tezi) Ankara: Ankara Üniversitesi, SBE.

e-devlet portalı. e devlet . (20.03.2018) tarihinde <http://www.edevlet.gov.tr/2016/07/25/2016-2019-ulusal-e-devlet-stratejisi-ve-eylem-plani/>

Uçkan, Ö. (2003). E-devlet, E-Demokrasi ve Türkiye. İstanbul: Literatür Yayınları.



**ENERJİ TÜKETİMİ VE EKONOMİK BÜYÜME İLİŞKİSİ: NIC ÜLKELERİ İÇİN AMPİRİK
BİR ANALİZ**

Fatma KIZILKAYA*

Mehmet DAĞ**

ÖZET

Sosyal ve ekonomik kalkınma için önemli makroekonomik unsurlardan biri olan enerji, gelişmiş ve gelişmekte olan ülkeler için oldukça önemli bir girdidir. Enerji tüketimi ve ekonomik büyüme ise birbirleri için neden olabilmekte ve birbirlerini etkileyebilmektedirler. Bu çalışmada 1971-2014 dönemi verileri kullanılarak, Yeni Sanayileşmiş Ülkelerde (Newly Industrialized Countries: NIC) büyüme ve enerji tüketimi ilişkisi incelenmiştir. Seriler arasında nedensellik ilişkisi Konya (2006) tarafından önerilen nedensellik testi ile araştırılmıştır. Elde edilen nedensellik testi bulgularına göre Çin ve Filipinler için büyüme hipotezinin; Brezilya, Endonezya, Hindistan, Meksika, Malezya, Tayland, Türkiye ve Güney Afrika için ise tarafsızlık hipotezinin geçerliliğini destekleyen sonuçlara ulaşılmıştır.

Anahtar Kelimeler: Enerji Tüketimi, Ekonomik Büyüme, Nedensellik Testi, Büyüme Hipotezi, Tarafsızlık Hipotezi

JEL Kodları: C33, O40, Q40

**THE RELATIONSHIP BETWEEN ENERGY CONSUMPTION AND ECONOMIC
GROWTH: AN EMPIRICAL ANALYSIS FOR NIC COUNTRIES**

ABSTRACT

Energy, one of the major macroeconomic factors for social and economic development, is a very important input for both developed and developing countries. Energy consumption and economic growth can affect each other. In this study, relationship between economic growth and energy consumption in NIC (Newly Industrialized Countries: NIC) is analysed using data from the period 1971-2014. The causality relationship between the series is investigated by the causality test proposed by Konya (2006). The results show that the growth hypothesis is valid for China and Philippines, and the neutrality hypothesis is valid for Brazil, Indonesia, India, Mexico, Malaysia, Thailand, Turkey, and South Africa.

* Öğr.Gör, Hakkâri Üniversitesi Yükseköğretim Fakültesi, Meslek Yüksekokulu, Hakkâri, Türkiye, fatmakizilkaya@hakkari.edu.tr

** Dr. Öğr.Üyesi, Siirt Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Maliye Bölümü, Siirt, Türkiye, mehmetdag323@gmail.com

Keywords: Energy Consumption, Economic Growth, Causality Test, Growth Hypothesis, Neutrality Hypothesis

JEL Codes: C33, O40, Q40

1. GİRİŞ

Enerji, ekonomik ve sosyal kalkınma açısından üretim sürecinde temel girdi olarak kullanılmaya devam etmesi nedeniyle günümüzün öncelikli konularından biridir. Ekonomiler için enerjinin önemi her geçen gün artmaktadır. Dahası, enerji, ülkelerin kalkınma düzeyini etkilemekte ve ülkelerin uluslararası politikalarını belirlemede önemli bir rol oynamaktadır. Bu bağlamda, enerji kaynaklarının kullanımının ve enerji talebindeki artışın ekonomik büyümenin nedenleri olduğu söylenebilir. Ekonomik büyüme ve enerji tüketiminin bağlantısının mevcut olup olmaması enerji düzenlemelerini koordine etmenin temel bir göstergesidir. Öte yandan, ekonomik büyüme ile enerji tüketimi arasındaki nedensel ilişkide, enerji tüketimini azaltan çevre koruma politikaları ekonomik büyümeyi olumsuz yönde etkileyebilmektedir.

Günümüzde enerji, ekonomik büyümeyi sağlamak ve sürdürmek için sürekli ve sürdürülebilir bir şekilde sağlanacak bir kaynak olarak görülmektedir. Enerji tüketiminin miktarı doğrudan ekonomik büyüme performansına bağlı olarak kabul edilmektedir. Ekonomik büyüme ve enerji tüketimi ile kentleşme arasındaki bağ, araştırmacılar için önemli bir konudur. Ekonomik büyüme ve enerji tüketimi ilişkisinin nedensellik boyutunu inceleyen çalışmalar neticesinde elde edilen bulgular doğrultusunda dört temel hipotezin ortaya çıktığı ifade edilebilir. Bu hipotezler (Öztürk, 2010:340-341);

(1) "Tarafsızlık Hipotezi": Enerji tüketimi ve Gayri Safi Yurt İçi Hasıla arasında bir nedenselliğin bulunmadığı durum tarafsızlık hipotezi olarak adlandırılmaktadır. Bu durum enerji tüketimi GSYİH ile ilişkili olmadığını ifade etmektedir, bu nedenle enerji tüketimi ile ilişkili politika değişikliklerinin ekonomik büyüme üzerinde etkisi olmayacaktır.

(2) "Koruma Hipotezi": Ekonomik büyümeden enerji tüketimine doğru tek yönlü bir nedenselliğin bulunduğu durumlar "koruma hipotezi" olarak adlandırılmaktadır. Bu şekilde adlandırılmasının temel nedeni bu hipotezin enerji tüketimini azaltmak için tasarlanan enerji koruma politikalarının reel ekonomik büyüme üzerinde olumsuz etkide bulunmayacağını öne sürmesidir. Buna göre, reel ekonomik büyümenin artışının enerji tüketiminde artışa neden olduğu durumlarda koruma hipotezi geçerli olacaktır.

(3) "Büyüme Hipotezi": Üretim sürecinde enerji tüketiminin doğrudan ve dolaylı olarak emek ve sermaye faktörlerinin tamamlayıcısı bir fonksiyona sahip olduğunu öngören yaklaşım büyüme hipotezi olarak ifade edilmektedir. Bu hipotezin doğrulaması enerji tüketiminde meydana gelen artışın reel GSYİH üzerinde bir artışa neden olduğu durumlarda sağlanmaktadır. Bu durumda enerji tüketiminin azalmasına yol açan politikalar reel GSYİH üzerinde azaltıcı etkilere yol açacaktır.

(4) "Geri Besleme Hipotezi": Bu hipotez enerji tüketimi ve reel GSYİH arasında çift yönlü nedensellik bulunduğu noktasından hareketle enerji tüketimi ve reel GSYİH'in birbirlerini tamamlayıcı bir ilişkiye sahip olduğu görüşüne dayanmaktadır. Buna bağlı olarak, enerjinin verimli tüketilmesine odaklı politikalar reel GSYİH üzerinde bozucu etkilere neden olmayacaktır.

2. LİTERATÜR İNCELEMESİ

Enerji tüketimi ve büyüme ilişkisini ele alan çalışmalara bakıldığında, söz konusu çalışmaların çoğunluğunun büyümenin daha fazla enerji tüketimine yol açtığı bulgusuna ulaştığı görülmektedir. Sürdürülebilir ekonomik büyüme, enerjinin önemini giderek arttırmaktadır. Buna göre, ekonomik büyüme ile enerji tüketimi arasındaki bağlantının anlamı, ekonomistler ve politika yapımcılar için merkezi bir rol oynamaktadır. Ülke ekonomisinin gelişiminde belirleyici bir faktör olan enerji tüketimi, ülkelerin kalkınma düzeyi ile doğru orantılıdır. Ancak dünyadaki yeraltı ve yerüstü enerji kaynaklarının miktarı sınırlıdır ve dünyadaki teknolojik gelişmeler nedeniyle enerji talebi artmaktadır.

Literatürde enerji tüketimi ile ekonomik büyüme arasındaki ilişki hakkında çok sayıda ampirik çalışma bulunmaktadır. Enerji tüketimi ve ekonomik büyüme arasındaki bağ, enerji tüketiminin ve ekonomik büyümenin arasında nedensel bir ilişki olduğunu göstermektedir. Kraft ve Kraft (1978) tarafından yapılan çalışma, bu ilişkiyi araştıran ilk çalışmadır. Bu çalışmada, ABD ekonomisi 1947-1974 dönemi verileriyle incelenmiş ve ekonomik büyümeden enerji tüketimine doğru nedensellik ilişkisi olduğu belirlenmiştir. Akarca ve Long (1980), Amerika Birleşik Devletleri için 1947 ve 1972 yıllarını kapsayan verileri kullanarak, ilişkiyi test etmiş ve değişkenler arasında bir ilişki bulunmadığı sonucuna varmıştır. Erol ve Yu (1987), sanayileşmiş ülkeleri inceleyen çalışmalarının sonuçlarına göre GSYİH'dan enerji tüketimine doğru bir ilişki olduğunu bulmuşlardır. Stern, (1993) ve (2000), ABD için çok değişkenli eşbütünleşme modelleri kullanarak enerji tüketimi ile GSYİH arasındaki ilişkiyi incelemiş ve her iki çalışmada da bir ilişki bulamamıştır. Cheng (1997), Granger nedensellik analizi ile Tayvan için enerji tüketimi ile GSYİH arasındaki nedensellik araştırmıştır. Analiz sonuçları, 1953-1993 dönemi için GSYİH'den enerji tüketimine nedensellik bulunduğunu göstermiştir. Masih ve Masih (1997), enerji tüketimi, reel gelir ve enerji fiyatları değişkenlerini kullanarak, Tayvan ve Güney Kore için enerji tüketimi ile GSYİH arasında çift yönlü bir ilişki bulmuşlardır. Asafu ve Adjaye (2000), Tayland ve Filipinler için iki yönlü nedensellik ilişkisini ve enerji tüketiminden Hindistan ve Endonezya'nın gelirine tek yönlü nedensellik ilişkisini bulmuşlardır.

Bozoklu ve Yılcı (2013), 20 OECD ülkesi için enerji tüketimi ile ekonomik büyüme arasındaki nedensel ilişkiyi incelemiştir. Ampirik sonuçlar, GSYİH'den enerji tüketimine doğru olan nedensellik açısından, Avustralya, Avusturya ve Kanada için geçici bir ilişki olduğunu göstermiştir. İtalya, Japonya, Meksika, Hollanda, Portekiz, İngiltere, ABD ve Avusturya, Belçika, Danimarka, Almanya, İtalya, Japonya, Hollanda, Norveç ve ABD için kalıcı bir ilişki bulgusu elde edilmiştir. Buna ek olarak, enerji

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

tüketiminden GSYİH'a uzanan nedensellik açısından, Avusturya, Danimarka, İtalya, Hollanda, Norveç ve Portekiz için geçici bir ilişki ve Belçika, Finlandiya, Yunanistan, İtalya, Japonya ve Portekiz için kalıcı bir ilişki olduğu ortaya konulmuştur.

Khan vd. (2014), Güney Asya'nın ekonomik büyümesini etkileyen faktörleri belirlemek için 1975-2011 dönemine ait verileri eşbütünleşme ve nedensellik testleri ile analiz etmişlerdir. Analiz sonucunda Güney Asya ülkelerinde enerji tüketimi, ekonomik büyüme ve finansal gelişme arasında iki yönlü nedenselliğin olduğu tespit edilmiştir

Saidi ve Hammami (2015), 1990–2012 dönemine ilişkin enerji tüketimi ve CO₂ emisyonlarının ekonomik büyüme üzerindeki etkisini 58 ülkeye ait verileri kullanarak dinamik panel veri analizi ile araştırmışlardır. Çalışmada ülkeler Avrupa ve Kuzey Asya, Latin Amerika ve Karayipler ve Sahra Altı, Kuzey Afrika ve Orta Doğu şeklinde bölgelere ayrılmıştır. Ampirik kanıtlar, tüm bölgeler için CO₂ emisyonlarının enerji tüketimi üzerindeki önemli olumlu etkisini göstermiştir. Sonuçlar ayrıca, ekonomik büyümenin enerji tüketimi üzerinde pozitif bir etkisi olduğunu göstermiştir.

Alper ve Oğuz (2016), asimetrik nedensellik testi yaklaşımı ve otoregresif dağıtılmış gecikme (ARDL) yaklaşımı kullanılarak 1990–2009 döneminde yeni AB üye ülkeleri için ekonomik büyüme, yenilenebilir enerji tüketimi, sermaye ve işgücü arasındaki nedenselliği araştırmıştır. Çalışma sonuçları, yenilenebilir enerji tüketiminin, incelenen tüm ülkeler için ekonomik büyüme üzerinde olumlu etkileri olduğunu desteklemektedir. Ancak ele alınan ülkelerden yalnızca Bulgaristan, Estonya, Polonya ve Slovenya için enerji tüketiminin ekonomik büyüme üzerinde istatistiksel olarak anlamlı bir etkisi bulgusu elde edilmiştir. Bununla birlikte, sonuçlar Kıbrıs, Estonya, Macaristan, Polonya ve Slovenya için tarafsızlık hipotezini desteklemiştir.

Gözgör vd. (2017), 1990'dan 2013'e kadar olan dönem için 29 Ekonomik Kalkınma ve İşbirliği Teşkilatı (OECD) ülkesinin panel verisinde yenilenebilir ve yenilenemeyen enerji tüketiminin ekonomik büyüme üzerindeki etkilerini ampirik olarak analiz etmiştir. Çalışma, panel otoregresif dağıtılmış gecikme (ARDL) ve panel kantil regresyon (PQR) tahminlerini dikkate alarak elde ettiği sonuçlar ile sadece ekonomik karmaşıklığın değil, aynı zamanda yenilenemeyen ve yenilenebilir enerji tüketiminin de, daha yüksek bir ekonomik büyüme oranı ile pozitif ilişkili olduğunu göstermektedir.

Amri (2017), 1990'dan 2012'ye kadar 72 ülkenin ekonomik büyüme, yenilenebilir enerji ve ticaret bilgisini araştırmak için dinamik panel veri yaklaşımını kullanmıştır. İlişkinin analizi tüm ülkeleri üç gruba ayırmak suretiyle gerçekleştirilmiştir. Sonuçlar, milli gelir ve yenilenebilir enerji tüketimi arasında, ticaret ve yenilenebilir enerji tüketimi arasında ve ticaret ve gelir arasında, dikkate alınan üç değişkenin birbirine bağlı olduğunu gösteren ilişki bulunduğunu göstermektedir.

3. EKONOMETRİK YÖNTEM VE BULGULAR

Bu çalışmada, 1971-2014 dönemi verileri kullanılarak, Yeni Sanayileşmiş Ülkeler (NIC: Brezilya, Çin, Endonezya, Hindistan, Meksika, Malezya, Filipinler, Tayland, Türkiye ve Güney Afrika) için büyüme ve enerji tüketimi ilişkisi incelenmiştir. Çalışmada enerji kullanımı (kişi başına düşen petrol eşdeğeri kg) ve kişi başı reel GSYİH verileri kullanılmıştır. Değişkenler arasındaki nedensellik ilişkisi Konya (2006) tarafından geliştirilen panel nedensellik testi ile incelenmiştir. Analizde kullanılan veriler Dünya Bankası veri dağıtım sistemi (<http://data.worldbank.org>) web sayfasından elde edilmiştir. Değişkenlerin logaritmik dönüşümleri yapıldıktan sonra analize dâhil edilmiştir. Panel veride değişkenler arasında nedensellik ilişkisini test etmek için öncelikle panel üyeleri arasında olası bir yatay kesit bağımlılığını ve eğim heterojenliğini araştırmak gerekmektedir. Yatay kesit bağımlılığı ve homojenlik testi sonuçları Tablo 1’de verilmiştir.

Tablo 1. Yatay Kesit Bağımlılığı ve Heterojenlik Testi Sonuçları

| Yöntem | Test İstatistiği | p-değeri |
|--|------------------|----------|
| <i>Yatay Kesit Bağımlılığı Testi</i> | | |
| <i>CD_{BP} (Breusch -Pagan 1980)</i> | 228.114* | 0.000 |
| <i>Pesaran CD (Pesaran 2004)</i> | -1.540*** | 0.062 |
| <i>LM_{adj} (Pesaran vd. 2008)</i> | 64.340* | 0.000 |
| <i>Homojenlik Testi</i> | | |
| $\hat{\Delta}$ | 2.805* | 0.003 |
| $\hat{\Delta}_{adj}$ | 2.904* | 0.002 |

Not: *, ** ve *** sırasıyla; %1, %5 ve %10 düzeyinde anlamlılığı göstermektedir.

Tablo 1 incelendiğinde, CD_{BP} , Pesaran CD ve LM_{adj} testlerine göre yatay kesit bağımlılığını olduğuna karar verilmiştir. Ayrıca $\hat{\Delta}$ ve $\hat{\Delta}_{adj}$ testleri için eğim katsayılarının heterojen olduğu sonucuna ulaşılmıştır.

Konya (2006) tarafından geliştirilen panel bootstrap nedensellik testi Görünürde İlişkiz Regresyon (SUR) modellerine ve ülkeye özgü bootstrap kritik değerlere sahip Wald testine dayanmaktadır. Panel bootstrap nedensellik testi için kullanılacak denklem kümesi şu şekildedir;

$$\begin{aligned}
 Y_{1,t} &= \alpha_{1,1} + \sum_{l=1}^{mly_1} \beta_{1,1,l} Y_{1,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_1} \delta_{1,1,l} X_{1,t-l} + \varepsilon_{1,1,t} \\
 Y_{2,t} &= \alpha_{1,2} + \sum_{l=1}^{mly_1} \beta_{1,2,l} Y_{2,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_1} \delta_{1,2,l} X_{2,t-l} + \varepsilon_{1,2,t}
 \end{aligned} \tag{1}$$

□

$$\begin{aligned}
 Y_{N,t} &= \alpha_{1,N} + \sum_{l=1}^{mly_1} \beta_{1,N,l} Y_{N,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_1} \delta_{1,N,l} X_{N,t-l} + \varepsilon_{1,N,t} \\
 X_{1,t} &= \alpha_{2,1} + \sum_{l=1}^{mly_2} \beta_{2,1,l} Y_{1,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_2} \delta_{2,1,l} X_{1,t-l} + \varepsilon_{2,1,t} \\
 X_{2,t} &= \alpha_{2,2} + \sum_{l=1}^{mly_2} \beta_{2,2,l} Y_{2,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_2} \delta_{2,2,l} X_{2,t-l} + \varepsilon_{2,2,t}
 \end{aligned} \tag{2}$$

□

$$X_{N,t} = \alpha_{2,N} + \sum_{l=1}^{mly_2} \beta_{2,N,l} Y_{N,t-l} + \sum_{l=1}^{mlx_2} \delta_{2,N,l} X_{N,t-l} + \varepsilon_{2,N,t}$$

Burada N panelin ülke sayısını ($i=1, \dots, N$), t zaman boyutunu ($t=1, \dots, T$), l ise gecikme uzunluğunu ifade etmektedir. Bu sistemdeki Granger nedenselliğini test etmek için, ülke j için alternatif nedensellik ilişkilerin bulunması muhtemeldir: Örneğin Denklem (1) ve (2) incelendiğinde eğer bütün $\delta_{1,j,l}$ 'ler sıfır değil fakat bütün $\beta_{2,j,l}$ 'ler sıfır ise X'ten Y'ye tek yönlü Granger nedensellik vardır. Elde edilen Wald istatistiği bootstrap kritik değerlerinden büyükse, değişkenler arasında nedensellik ilişkisi olmadığını ifade eden sıfır hipotezi reddedilmektedir. Panel bootstrap nedensellik testi sonuçları Tablo 2'de sunulmuştur.

Tablo 2. Bootstrap Panel Nedensellik Testi Sonuçları

| Ülkeler | H_0 : Enerji tüketimi, büyümenin nedeni değildir. | H_0 : Büyüme, enerji tüketiminin nedeni değildir. |
|---------|---|---|
| | | |

| | Wald İstatistiği | p-değeri | Wald İstatistiği | p-değeri |
|---------------------|------------------|----------|------------------|----------|
| Brezilya | 31.419 | 0.766 | 6.568 | 0.993 |
| Çin | 2.507*** | 0.090 | 0.539 | 0.991 |
| Endonezya | 0.395 | 0.992 | 4.258 | 0.931 |
| Hindistan | 8.383 | 0.950 | 8.278 | 0.934 |
| Meksika | 0.291 | 0.990 | 0.227 | 0.990 |
| Malezya | 0.433 | 0.990 | 10.166 | 0.990 |
| Filipinler | 5.759** | 0.012 | 0.001 | 0.963 |
| Tayland | 9.718 | 0.187 | 10.550 | 0.999 |
| Türkiye | 0.026 | 0.990 | 3.198 | 0.990 |
| Güney Afrika | 0.397 | 0.994 | 0.479 | 0.773 |

Not: *, ** ve *** sırasıyla; %1, %5 ve %10 düzeyinde anlamlılığı göstermektedir. Bootstrap kritik değerleri 10.000 döngüyle elde edilmiştir.

Tablo 2 ile verilen Wald istatistikleri incelendiğinde enerji tüketiminin, büyümenin nedeni olmadığını ifade eden sıfır hipotezi Çin ve Filipinler için reddedilmektedir. Yani Çin ve Filipinler için enerji tüketimi büyümenin nedenidir. Büyümenin, enerji tüketiminin nedeni olmadığını ifade eden sıfır hipotezi ise bütün NIC ülkeleri için reddedilememektedir. Yani NIC ülkeleri için büyüme enerji tüketiminin nedeni değildir.

4. SONUÇ

Bu çalışmada, NIC ülkeleri için enerji tüketimi ve büyüme arasındaki nedensellik ilişkisi analiz edilmiştir. Elde edilen sonuçlar Çin ve Filipinler için enerji tüketiminden büyümeye doğru nedensellik ilişkisinin olduğunu göstermektedir. Ayrıca NIC ülkelerinin hiçbirinde büyümeden enerji tüketimine doğru nedensellik ilişkisi elde edilememiştir. Elde edilen nedensellik testi bulgularına göre Çin ve

Filipinler için büyüme hipotezinin; Brezilya, Endonezya, Hindistan, Meksika, Malezya, Tayland, Türkiye ve Güney Afrika için ise tarafsızlık hipotezinin geçerliliğini destekleyen sonuçlara ulaşılmıştır.

Çalışmanın sonuçları, ele alınan ülkeler arasında Çin ve Filipinler için büyüme hipotezinin, diğer ülkeler için ise tarafsızlık hipotezinin geçerli olduğunu ortaya koymaktadır. Bu yönüyle çalışma, literatürdeki çalışmalardan Stern (1993,2000) ve Altınay ve Karagöl (2004) tarafından yapılan çalışmaların bulgularıyla benzer bulgular elde etmiştir. Elde edilen bulgular doğrultusunda, enerji tüketimi ile ilgili politika düzenlemelerinin ekonomik politikayı etkileyemeyeceğinden hareketle ülkelerin gelir politikaları geliştirmeleri mümkündür. Buna göre enerji tüketimi üzerinden alınan vergilere artışa gidilmesi büyümeyi olumsuz etkilemeyeceğinden bu alandaki vergiler artırılarak kamu gelirlerinde artış sağlanabilecektir. Çin ve Filipinler gibi büyüme hipotezinin geçerli olduğu ülkeler açısından ise enerji teşvik politikalarının koruma politikalarına oranla ekonomik büyüme üzerinde daha fazla destekleyici rol oynayacağı düşünülmektedir. Enerji tüketimi-büyüme ilişkisinin incelenmesi açısından gelecekteki çalışmalarda büyümeyi etkileyen diğer faktörlerin de analizlere eklenmesi bu alanda daha detaylı analizler yapılması hususunda katkı sağlayabilecektir.

KAYNAKÇA

- Akarca, A. T., & Long, T. V. (1980). "On the Relationship between Energy and GNP: A Reexamination". *The Journal of Energy and Development*, 326-331.
- Alper, A., & Oguz, O. (2016). "The Role of renewable Energy Consumption in Economic Growth: Evidence from Asymmetric Causality". *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 60: 953-959.
- Altınay, G. ve E. Karagöl (2004). "Structural Break, Unit Root, and the Causality between Energy Consumption and GDP in Turkey", *Energy Economics*, 26: 985-994.
- Amri, F. (2017). "Intercourse across Economic Growth, Trade and Renewable Energy Consumption in Developing and Developed Countries". *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 69: 527-534.
- Asafu-Adjaye, J.,(2000). "The Relationship between Energy Consumption, Energy Prices and Economic Growth: Time Series Evidence from Asian Developing Countries." *Energy Economics*, 22: 615-625.
- Bozoklu, S., & Yilanci, V. (2013). "Energy Consumption and Economic Growth for Selected OECD Countries: Further Evidence from the Granger Causality Test in the Frequency Domain". *Energy Policy*, 63: 877-881.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Breusch, T. S., & Pagan, A. R. (1980). "The Lagrange Multiplier Test and Its Applications to Model Specification in Econometrics". *The Review of Economic Studies*, 47(1): 239-253.
- Cheng S.B., Lai, W.T.,(1997), "An Investigation Of Co-integration And Causality Between Energy Consumption And Economic Activity In Taiwan, Province of Chine", *Energy Economics*, 19: 435-444.
- Erol U., E.S.H. Yu (1987), "On The Causal Relationship Between Energy And Income For Industrializing Countries", *Journal of Economics and Developments* ,13: 113-122.
- Gozgor, G., Lau, C. K. M., & Lu, Z. (2018). "Energy Consumption and Economic Growth: New Evidence from the OECD Countries". *Energy*, 153: 27-34.
- Hondroyannis, G., Lolos, S., & Papapetrou, E. (2002). "Energy Consumption and Economic Growth: Assessing the Evidence from Greece". *Energy Economics*, 24(4): 319-336.
- Khan, M. A., Khan, M. Z., Zaman, K., Irfan, D., & Khatab, H. (2014). "Questing the Three Key Growth Determinants: Energy Consumption, Foreign Direct Investment and Financial Development in South Asia". *Renewable Energy*, 68(C): 203-215.
- Kónya, L. (2006). "Exports and Growth: Granger Causality Analysis on OECD Countries with a Panel Data Approach". *Economic Modelling*, 23(6): 978-992.
- Kraft, J., Kraft, A., 1978. "On the Relationship between Energy and GNP". *Journal of Energy Development* 3: 401-403.
- Masih, A. M. M., Masih R., (1997). "On the Temporal Causal Relationship Between Energy Consumption, Real Income and Prices: Some Evidence From Asian-Energy Dependent NICs Based on A Multivariate Cointegration/ Vector Error Correction Approach", *Journal of Policy Modelling*, 19: 417-440.
- Öztürk, İ. (2010). "A Literature Survey On Energy-Growth Nexus", *Energy Policy*, 38: 340-349
- Pao, H.T., (2009). "Forecast of Electricity Consumption and Economic Growth in Taiwan by State Space Modeling". *Energy* 34: 1779-1791.
- Pesaran, M. H. (2004). "General Diagnostic Tests for Cross Section Dependence in Panels". *Journal of Econometrics* 142: 50-93.
- Pesaran, M. H. (2006). "Estimation and Inference in Large Heterogeneous Panels with a Multifactor Error Structure". *Econometrica*, 74(4), 967-1012.
- Pesaran, M. H., & Yamagata, T. (2008). "Testing Slope Homogeneity in Large Panels". *Journal of Econometrics*, 142(1): 50-93.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Pesaran, M. H., Ullah, A., & Yamagata, T. (2008). "A Bias Adjusted LM Test of Error Cross-Section Independence". *The Econometrics Journal*, 11(1): 105-127.

Saidi, K., & Hammami, S. (2015). "The Impact of CO 2 Emissions and Economic Growth on Energy Consumption in 58 Countries". *Energy Reports*, 1: 62-70.

Stern, D.I., (1993). "Energy and Economic Growth in the USA". *Energy Economics*, 15: 137–150.

Stern, D.I., (2000). "Multivariate Cointegration Analysis of the Role of Energy in the US Macroeconomy". *Energy Economics*, 22: 267–283.



**AYLAK TABANLI SÜPER ETKİNLİK MODELİ İLE TÜRKİYE'DEKİ İLLERİN
ENERJİ ETKİNLİĞİNİN DEĞERLENDİRİLMESİ**

Serpil GÜMÜŞTEKİN AYDIN*

ÖZET

Dünya'daki ekonomik gelişmeler neticesinde, enerji talebine olan gereksinim de büyük ölçüde artış göstermektedir. Dolayısıyla, küresel enerji ve ekonomik dönüşüm için kullanılan enerjinin en verimli olacak şekliyle iyileştirilmesi şarttır. Türkiye'yi ele aldığımızda, ülkemizde bulunan illerin enerji verimliliğine yönelik olan bu çalışma, Türkiye'nin enerji kullanım durumunu daha iyi anlamak ve verimliliği arttırmak için nasıl politikalar izlemeliyiz sorusunun cevaplarını bulmaya katkı sağlayabilir. Bu çalışmada, istenmeyen (undesirable) çıktılar dahil olduğu, aylak tabanlı ölçüm (slack – based measure) modeli kullanılarak Türkiye'de bulunan illerin 2015 yılına ait enerji verimliliği araştırılmıştır. Sonuçlar, Türkiye'nin genel enerji verimliliğinin, istenmeyen çıktılar ile birlikte değişim gösterdiğini ifade etmektedir. Buna ek olarak, iller arasındaki enerji verimliliği açığı büyük çıkmıştır. Bu nedenle, bölgesel koşulları göz önünde bulundurarak ve hedeflenen politikaları geliştirerek, ülkemizin genel enerji verimliliğini geliştirmek gerekmektedir.

Anahtar Kelimeler: Enerji, Etkinlik, SBM, Veri Zarflama Analizi

JEL Kodları: C44, C61, C67.

**SLACK BASED MEASURED SUPER EFFICIENCY MODEL WITH UNDESIRABLE
VARIABLES: ENERGY EFFICIENCY IN TURKEY**

ABSTRACT

As a result of the economic developments in the world, the need for energy demand is greatly increased. Therefore, the energy used for global energy and economic transformation must be improved in the most efficient manner. When we talk about for Turkey, this study, which for the provincial energy efficiency in our country, better understand the situation and we have to watch how policies can contribute to increase the efficiency of finding answers to questions. In this study, based on the super efficiency slack – based measure model with undesirable variables, the energy efficiency of Turkey's provinces in 2015 was investigated. The results of Turkey's overall energy efficiency, suggesting that

* Ondokuz Mayıs Üniversitesi, Fen Edebiyat Fakültesi, İstatistik Bölümü, Samsun, Türkiye, E – mail: serpil.gumustekin@omu.edu.tr

vary with undesirable outcomes. In addition, the energy efficiency has been large between gap and provinces. Therefore, it is necessary to improve the general energy efficiency of our country by considering the regional conditions and developing the targeted policies.

Keywords: Energy, Efficiency, SBM, Data Envelopment Analysis

JEL Codes: C44, C61, C67.

1. GİRİŞ

Enerji fiyatlarının artması, enerji kaynaklarının kıtlığı, enerji güvenliği ve sürdürülebilir kalkınma sorunlarının ortaya çıkmasıyla birlikte, hükümetler, birçok büyük enerji tüketim ülkesinde enerji tasarrufu sağlamak için enerji verimliliğinin ölçülmesi ve iyileştirilmesi konusunda giderek endişe duymaktadır. Çevre üzerindeki olumsuz etkileri ne olursa olsun fosil yakıt tüketimi artarken, günümüzde dünya gündemi sürekli ekonomik kalkınma ve çevresel sürdürülebilirliği devam ettirebilmek için sürdürülebilir enerji sistemlerine odaklanmaktadır. Türkiye'deki toplam enerji tüketiminin yarısından fazlası ithalatla karşılanmaktadır. Bunun da yakın gelecekte artmaya devam edeceği öngörülmektedir. Türkiye, ülkedeki toplam enerji ağıının bir parçası olabilen oldukça yüksek düzeyde yenilenebilir enerji kaynaklarına sahip bir ülkedir (Hepbaşlı vd. 2001). Bu nedenle, ülke talebini yerel kaynaklardan temin etmek istiyorsa, geleneksel enerji kaynaklarından (örneğin kömür, linyit, petrol ve doğal gaz gibi fosil yakıtlar) yenilenebilir enerji kaynaklarına geçişin yakın gelecekte gerekli olduğu görülmektedir (Ediger ve Kentel, 1999). Enerjinin ithal ikamesi, bir ekonominin GSYİH'sini ve ticaret dengesini artırma üzerinde doğrudan ve dolaylı etkilere sahiptir. Enerji verimliliğinde iyileştirme, toplam faktör verimliliğine dayalı olduğu için, ekonomilerin enerji verimliliğini analiz etmek için teknik verimlilik endeksi hesaplanmıştır (Boyd ve Pang, 2000). Bu endeks, GSYİH'nin ekonomik çıktısını üretmek için enerji, işgücü ve sermaye stoğunu çoklu girdiler olarak içermektedir.

Enerji verimliliği konusunda ilk çalışma Färe, Grosskopf ve Logan tarafından 1983 yılında elektrik üretim tesislerinin enerji etkinliğinin değerlendirilmesi olarak yayınlanmıştır. Daha sonra, pek çok çalışmada enerji verimliliği konuları ele alınmış ve gözden geçirilmiştir (Martinez vd., 2016; Moya vd., 2016; Bian vd., 2016; Balitsky vd., 2016; Luong, 2015).

Veri zarflama analizi (VZA) karşılaştırılabilir organizasyonların veya ürünlerin performansının değerlendirilmesi amacıyla girdilerin çıktılara dönüştürülmesi için doğrusal programlama teknikleri kullanan matematiksel bir yöntemdir. Her bir karar verme birimi, göreceli verimliliğini en üst düzeye çıkarmak için herhangi bir girdi ve çıktı kombinasyonu seçmekte serbesttir. Etkinlik skoru, toplam çıktının toplam girdiye oranıdır (Zhu, 2014). Makro ekonomi düzeyinde, VZA, enerji verimliliğini incelemekte son zamanlarda popüler hale gelmiştir çünkü nispi enerji verimliliğini incelerken çoklu girdi ve çoklu çıktılarla işlem yapabilme imkânı sunmaktadır. VZA'da en iyi üretim sınırı üzerinde yer

alan karar verme biriminin alacağı etkinlik skoru 1 değeridir. Çok sayıda KVB'nin 1 değerini alması durumunda da bunları birbirinden ayıracak olan süper etkinlik modelidir. Çalışmada, süper etkinlik modelinin hesaplanmasında Tone (2002) tarafından geliştirilen aylak tabanlı uzaklık fonksiyonu kullanılarak, Türkiye'deki illerin 2015 yılındaki enerji etkinliği incelenmiştir.

2. YÖNTEM

Charnes, Cooper ve Rhodes (1978), Veri Zarflama Analizi (VZA)'ni modern iktisadın temel taşları olan üretim fonksiyonları ve / veya verimli üretim imkanına benzer olarak, ilişkilerin ampirik tahminlerini elde etmenin yeni bir yolunu sağlayan gözlemsel verilere uygulanan matematiksel bir programlama modeli olarak tanımlamıştır. VZA, birden fazla girdiyi birden fazla çıktıya dönüştüren Karar Verme Birimleri (KVB) adı verilen bir dizi varlığın performansını değerlendirmek için nispeten yeni bir veri odaklı yaklaşımdır (Guyader vd., 2005). VZA, çoklu girdi ve çoklu çıktı faktörlerinin gözlemlendiği ve bunların bir toplam girdi veya çıktı faktörüne dönüştürülmesinin mümkün olmadığı durumlarda verimliliğin ölçülmesi için kullanılan bir yöntemdir. Binlerce makalenin yayınlandığı VZA, çeşitli alanlarda kullanılmıştır. Veri Zarflama Analizi, içinde çeşitli modelleri barındıran bir kavramlar ve metodolojiler bütünüdür. Bu modellerin her biri, yönetsel ve ekonomik sorunları ele alırken ve yararlı sonuçlar verirken, yönleri farklıdır. Bu nedenle modeller, ölçeklendirmek için artan, azalan veya sabit getirilere odaklanabilir:

- **CCR (Charnes, Cooper, Rhodes; 1978) Modeli:** Genel etkinliği hesaplar. Ölçeğe göre sabit getiri varsayımına dayanır. Kaynakları tanımlar ve bu şekilde belirlenen verimsizliklerin miktarını tahmin eder.

- **BCC (Banker, Charnes, Cooper; 1984) Modeli:** Ölçek ve teknik etkinlik arasındaki farkı ayırır eder. Saf teknik etkinliği hesaplar. Ölçeğe göre değişken getiri varsayımına dayanır.

- **Çarpımsal Modeller (Charnes vd., 1982,1983):** Log-doğrusal bir zarflamadır. Üretim sürecinin parçalı bir Cobb-Douglas yorumudur (Charnes, Cooper ve Sieford, 1981).

- **Toplamsal Modeller (Charnes vd., 1985) ve Genişletilmiş Toplamsal Modeller (Charnes vd., 1987):** Pareto optimalliğinin ekonomik kavramıyla etkinlik sonuçlarını ilişkilendiren modellerdir.

Ölçeğe göre sabit getiri ve ölçeğe göre değişken getiri olmak üzere, VZA' da ölçeğe dönüşler iki şekilde yapılmaktadır. Ölçeğe göre sabit getiri durumunda, eğer girdiler arttırılır veya azalır, çıktılar aynı oranlarda arttırılacak ve azalacaktır. Ölçeğe göre değişken getiri durumunda ise, eğer girdiler arttırılır veya azalır, çıktılar aynı oranlarda arttırılmayacağı veya azalmayacağı anlamına gelir (Banker vd., 2004).

Üç tip model yönü vardır. Birincisi, çıktıları sabit tutmak için gerekli olan girdileri azaltmayı nicelleştiren girdi yönelimli ölçümdür. İkincisi, girdileri sabit tutan gerekli çıktı genişlemesini ölçen

çıkıtı yönelimli ölçüm ve sonucusu hem girdiler hem de çıktılar eşzamanlı olarak geliştirilebildiğinde gerekli iyileştirmeleri ölçen yönlendirilmemiş ölçümdür.

VZA modelinin analiz sonuçlarında, birden fazla KVB'nin, özellikle girdi ve çıktılarının sayısı büyük olduğunda, verimli KVB'lerin sayısı da artacaktır. VZA modeli tarafından elde edilen maksimum verimlilik değeri 1'dir ve verimli KVB'lerin verimlilik değerleri aynıdır, bu durumda verimli KVB'ler arasındaki verimlilik düzeyini daha fazla ayırt edemeyiz. Bu problemi çözmek için, Andersen ve Petersen (1993) daha sonra "süper etkinlik" modeli olarak bilinen verimli KVB'lerin verim düzeyini daha fazla ayırt edebileceğimiz yöntemi önermiştir. Süper etkinlik modelinin temeli, değerlendirilen KVB'yi referans setinden hariç tutmaktır, diğer bir deyişle, değerlendirilen KVB'nin verimliliği, diğer KVB'lerin oluşturduğu sınırlara başvurularak elde edilir ve verimli KVB'lerin süper etkinlik değerleridir. Genellikle 1'den büyüktür, böylece verimli KVB'ler ayırt edilebilir. Andersen ve Petersen (1993) tarafından önerilen model radyal süper etkin bir model olmasına rağmen, prensipleri Tone (2002) tarafından önerilen SBM (slack based measure) süper etkinlik modeli için de geçerlidir. Ölçeğe göre sabit getiri varsayımına dayanan CCR modelinde süper etkinlik ve standart etkinlik modelleri arasındaki tek fark $j \neq k$ kısıtının modele eklenmesidir. Yani, değerlendirilen KVB referans kümeden çıkartılmıştır. Ölçeğe göre sabit getiri varsayımına dayanan CCR Süper Etkinlik modeli Eşitlik 2.1'de gösterilmektedir.

min θ

$$s. t. \sum_{j \neq k}^n \lambda_j x_{ij} \leq \theta x_{ik}$$

$$\sum_{j \neq k}^n \lambda_j y_{rj} \geq y_{rk}$$

$$\lambda \geq 0$$

$$i = 1, 2, \dots, m; r = 1, 2, \dots, q; j = 1, 2, \dots, n (j \neq k) \quad (2.1)$$

Ölçeğe göre değişen getiri varsayımına dayanan süper etkinlik modelinde ölçeğe göre sabit getiri varsayımına dayanan modele ek olarak $\sum_{j=1, j \neq k}^n \lambda_j = 1$ kısıtı eklenmektedir. Model, Eşitlik 2.2'de gösterilmektedir.

min θ

$$s. t. \sum_{j \neq k}^n \lambda_j x_{ij} \leq \theta x_{ik}$$

$$\sum_{j \neq k}^n \lambda_j y_{rj} \geq y_{rk}$$

$$\sum_{j=1, j \neq k}^n \lambda_j = 1$$

$$\lambda \geq 0$$

$$i = 1, 2, \dots, m; r = 1, 2, \dots, q; j = 1, 2, \dots, n (j \neq k) \quad (2.2)$$

Süper etkinlik modeli, verimli KVB'ler için tasarlanmasına rağmen, aynı zamanda verimsiz KVB'ler için de uygundur ve verimsiz KVB'lerin süper etkinlik radyal modeli, standart etkinlik radyal modeli ile aynı sonuçlara sahiptir.

Radyal süper etkinlik modelleri ve uzaklık fonksiyonu baz alınarak hesaplanan süper etkinlik modelleri karşılaştırıldığında, aylak tabanlı süper etkinlik modeli biraz daha karmaşıktır, çünkü bu yalnızca $j \neq k$ kısıtlama koşulunun eklenmesi değildir. Aylak tabanlı süper etkinlik modeli sadece etkin KVB'ler için geçerlidir ve aylak tabanlı bir KVB için etkinlik, yönelimli olmayan ölçeğe göre sabit getiri varsayımına dayanan süper etkinlik SBM modeli Eşitlik 2.3'deki gibi ifade edilir:

$$\begin{aligned} \min \rho_{SE} &= \frac{\frac{1}{m} \sum_{j=1}^m \bar{x}_i / x_{ik}}{\frac{1}{s} \sum_{r=1}^s \bar{y}_r / y_{rk}} \\ \text{s. t.} \quad x_i &\geq \sum_{j=1, j \neq k}^n x_{ij} \lambda_j \\ \bar{y}_r &\leq \sum_{j=1, j \neq k}^n y_{rj} \lambda_j \\ \bar{x}_i &\geq x_{ik} \\ \bar{y}_r &\leq y_{rk} \\ \lambda, s^-, s^+, \bar{y} &\geq 0 \\ i &= 1, 2, \dots, m; r = 1, 2, \dots, q; j = 1, 2, \dots, n (j \neq k) \end{aligned} \quad (2.3)$$

Değerlendirilen KVB hariç diğer KVB'lerden oluşan referans kümesi;

$$\{(x, y): |x \geq \sum_{j=1, j \neq k}^n x_j \lambda_j, y \leq \sum_{j=1, j \neq k}^n y_j \lambda_j\}$$

SBM süper etkinlik modelinde değerlendirilen k. KVB'nin projeksiyon değeri (\bar{x}, \bar{y}) , yani modelin optimal çözümü, diğer KVB'lerden elde edilen üretim imkânı kümesindeki sınırlara en yakın noktadır. Ölçeğe göre değişken getiri varsayımına dayanan SBM modeli Eşitlik 2.4'deki gibi ifade edilir:

$$\begin{aligned} \min \rho_{SE} &= \frac{1 + \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m s_i^- / x_{ik}}{1 - \frac{1}{s} \sum_{r=1}^s s_r^+ / y_{rk}} \\ \text{s. t.} \quad \sum_{j=1, j \neq k}^n x_{ij} \lambda_j - s_i^- &= x_{ik} \end{aligned}$$

$$\sum_{j=1, j \neq k}^n y_{rj} \lambda_j + s_r^+ = y_{rk}$$

$$\sum_{j=1, j \neq k}^n \lambda_j = 1$$

$$\lambda, s^-, s^+ \geq 0$$

$$i = 1, 2, \dots, m; r = 1, 2, \dots, q; j = 1, 2, \dots, n (j \neq k) \quad (2.4)$$

İstenmeyen çıktıyı içeren Tone (2002) tarafından tanımlanan SBM modeli (Cooper, vd., 2007) Eşitlik 2.5'deki gibi elde edilir:

$$\min \rho = \frac{1 - \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m s_i^- / x_{ik}}{1 + \frac{1}{q_1 + q_2} (\sum_{r=1}^{q_1} s_r^+ / y_{rk} + \sum_{t=1}^{q_2} s_t^b / b_{tk})}$$

$$s, t. X\lambda + s^- = x_k$$

$$Y\lambda - s^+ = y_k$$

$$B\lambda + s^b = b_k$$

$$\lambda, s^-, s^+ \geq 0$$

İstenmeyen çıktı, yönlü mesafe fonksiyonunda veya radyal modelde güçlü atılabilirlik olarak ayarlanmıştır. Üretim olasılıklarının, yalnızca istenmeyen çıktıların atılabilirlik gücüne dayandığı söylenebilir.

3. UYGULAMA

Çalışmada, 2015 yılında Türkiye'de bulunan illerin enerji etkinliğinin ölçülmesi amaçlanmıştır. Çalışmada kullanılan girdiler kurulu güç (MW), enerji tüketim miktarı (MWh) ve hat uzunluğu iken çıktılar yıllık yaklaşık üretim (GWh), abone sayısı ve lisanssız elektrik üretimi (MWh)'dir. Burada lisanssız elektrik üretimi istenmeyen çıktı olarak ele alınmıştır. Çünkü lisanssız elektrik üretimi sonucunda fazla üretilen elektrik sisteme aşırı yüklenen enerji olarak görülmektedir. Girdi ve çıktı değişkenlerine ait istatistiksel değerler Tablo 1'de ve analiz sonuçları Tablo 2'de verilmiştir.

Tablo 1. Girdi ve Çıktı Değişkenlerinin İstatistiksel Özellikleri

| 2015 | Kurulu Güç (MW) | Tüketim Miktarı (MWh) | Hat Uzunluğu (km) | Yıllık Yaklaşık Ürt (GWh) | Abone Sayısı (Kişi) | Lisanssız Elk. Ürt. (MWh) |
|------------|-----------------|-----------------------|-------------------|---------------------------|---------------------|---------------------------|
| Ortalama | 958,6 | 2387989,4 | 13214,0 | 3330,7 | 436688,9 | 2749,2 |
| Sta.Sapma | 1124,7 | 4483228,1 | 10323,3 | 4501,8 | 835129,7 | 7951,4 |
| Min.Değer | 80,0 | 86467,8 | 2.63,0 | 128,0 | 17382,0 | 0,0 |
| Max. Değer | 4249,0 | 35552868,1 | 58285,0 | 17991,0 | 6862812,0 | 63976,4 |

Çalışma sonucunda girdi yönlü ve çıktı yönlü aylak tabanlı süper etkinlik modelleri istenmeyen çıktı varlığında ayrı ayrı hesaplanmıştır. Elde edilen ölçeğe göre sabit getiri varsayımına dayanan CCR ve SBM CCR; ölçeğe göre değişken getiri varsayımına dayanan BCC ve SBM BCC modellerine ait etkinlik sonuçları incelendiğinde, aylak tabanlı etkinlik skorlarının geleneksel etkinlik skorlarına göre genel olarak düşük çıktığı görülmektedir. Bu sonucun çıkmasında, istenmeyen çıktının da etkisi fazladır. Veri zarflama analizinde çıktıyı maksimize etmek amaçlandığından dolayı etkinlik değerleri yüksek çıkmaktadır ve istenmeyen çıktı bu durumun tersine düşünüldüğü için etkinlik skorlarını azaltması normaldir. Aylak tabanlı modellerin etkinlik skorlarının bazılarında uygunsuz çözüm varlığından dolayı etkinlik skorları hesaplanamamıştır. Geleneksel etkinlik değerlendirme modelleri olan CCR ve BCC modellerinde etkinlik skoru 1 olan iller 2015 yılı için abone sayısı ve enerji üretiminde etkin illerdir. Etkinlik skoru 1 olan illerin hangilerinin daha iyi olduğunun belirlenmesi için de süper etkinlik skorlarına bakılmalıdır. Süper etkinlik skoru en yüksek il 2015 yılı için en etkin ildir. Girdi yönlü SBM CCR ve SBM BCC modeline göre Ağrı, çıktı yönlü SBM CCR ve SBM BCC modeline göre İstanbul en etkin illerdir.

Tablo 2. Analiz Sonuçları

| 2015 - İLLER | Girdi Yönlü | | | | Çıktı Yönlü | | | |
|--------------|-------------|--------|---------|---------|-------------|--------|---------|------------|
| | CCR | BCC | SBM CCR | SBM BCC | CCR | BCC | SBM CCR | SBM BCC |
| Adana | 0,7308 | 0,7662 | 0,7099 | 0,7179 | 0,7308 | 0,9088 | 0,6267 | 0,7342 |
| Adıyaman | 0,5027 | 0,5220 | 0,4141 | 0,4531 | 0,5027 | 0,5079 | 0,4704 | 0,4846 |
| Afyon | 0,8426 | 0,8911 | 0,7163 | 0,8306 | 0,8426 | 0,8990 | 0,4652 | 0,5607 |
| Ağrı | 1,0000 | 1,0000 | 7,0682 | 10,6703 | 1,0000 | 1,0000 | 1,4619 | Infeasible |
| Aksaray | 0,7174 | 0,7405 | 0,7349 | 0,7349 | 0,7174 | 0,7968 | 0,6242 | 0,6242 |
| Amasya | 0,8760 | 0,8866 | 0,7371 | 0,7383 | 0,8760 | 0,8781 | 0,7944 | 0,8571 |
| Ankara | 0,9709 | 1,0000 | 0,9160 | 1,0908 | 0,9709 | 1,0000 | 0,7290 | 1,0591 |
| Antalya | 0,7029 | 0,8207 | 0,6764 | 0,7099 | 0,7029 | 0,8261 | 0,6100 | 0,6771 |
| Ardahan | 0,5440 | 1,0000 | 0,4943 | 1,0450 | 0,5440 | 1,0000 | 0,5897 | 1,0442 |
| Artvin | 1,0000 | 1,0000 | 1,4420 | 1,4509 | 1,0000 | 1,0000 | 1,2802 | 1,2981 |
| Aydın | 0,7452 | 0,8901 | 0,6995 | 0,8410 | 0,7452 | 0,8987 | 0,6341 | 0,7027 |
| Balıkesir | 0,8586 | 1,0000 | 0,7321 | 1,0677 | 0,8586 | 1,0000 | 0,6792 | 1,0426 |
| Bartın | 1,0000 | 1,0000 | 1,1758 | 1,1774 | 1,0000 | 1,0000 | 1,1127 | Infeasible |
| Batman | 0,4153 | 0,5347 | 0,2436 | 0,4592 | 0,4153 | 0,4255 | 0,3088 | 0,3091 |
| Bayburt | 0,5057 | 1,0000 | 0,4234 | 1,5332 | 0,5057 | 1,0000 | 0,5019 | Infeasible |
| Bilecik | 0,5867 | 0,9056 | 0,4853 | 0,6561 | 0,5867 | 0,7357 | 0,5648 | 0,6366 |
| Bingöl | 0,9403 | 0,9854 | 0,9080 | 1,0426 | 0,9403 | 0,9834 | 0,8169 | 1,0502 |
| Bitlis | 1,0000 | 1,0000 | 0,6704 | 1,1776 | 1,0000 | 1,0000 | 0,5949 | Infeasible |
| Bolu | 0,4419 | 0,4823 | 0,4180 | 0,4406 | 0,4419 | 0,5079 | 0,4176 | 0,4371 |
| Burdur | 0,7294 | 0,7380 | 0,5937 | 0,5960 | 0,7294 | 0,7362 | 0,5098 | 0,5317 |
| Bursa | 0,7529 | 0,7715 | 0,6954 | 0,6998 | 0,7529 | 0,7770 | 0,5703 | 0,6059 |
| Çanakkale | 0,7864 | 0,8500 | 0,7394 | 0,7394 | 0,7864 | 0,8034 | 0,8358 | 0,8843 |
| Çankırı | 1,0000 | 1,0000 | 1,9276 | 1,9276 | 1,0000 | 1,0000 | 1,2453 | Infeasible |
| Çorum | 0,9599 | 0,9990 | 0,8652 | 0,9997 | 0,9599 | 0,9992 | 0,7197 | 0,9895 |
| Denizli | 0,7456 | 0,8121 | 0,5633 | 0,5964 | 0,7456 | 0,8219 | 0,5435 | 0,5842 |
| Diyarbakır | 0,6134 | 0,6163 | 0,6123 | 0,6143 | 0,6134 | 0,6393 | 0,6294 | 0,6883 |
| Düzce | 0,6513 | 0,7030 | 0,7937 | 0,7937 | 0,6513 | 0,6610 | 0,6866 | 0,7002 |
| Edirne | 0,8054 | 0,8157 | 0,7624 | 0,7693 | 0,8054 | 0,8241 | 0,6077 | 0,6099 |

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | | | | | | | |
|---------------|--------|--------|------------|------------|--------|--------|--------|------------|
| Elazığ | 0,7145 | 0,7278 | 0,7524 | 0,7581 | 0,7145 | 0,7514 | 0,7297 | 0,8369 |
| Erzincan | 0,5331 | 0,5969 | 0,4558 | 0,6058 | 0,5331 | 0,5612 | 0,5542 | 0,5607 |
| Erzurum | 0,4492 | 0,4625 | 0,4029 | 0,4143 | 0,4492 | 0,4695 | 0,5277 | 0,5283 |
| Eskişehir | 0,7844 | 0,8429 | 0,6884 | 0,6912 | 0,7844 | 0,8539 | 0,5708 | 0,5818 |
| Giresun | 1,0000 | 1,0000 | 1,0715 | 1,0715 | 1,0000 | 1,0000 | 1,0591 | 1,0591 |
| Gümüşhane | 0,5924 | 0,7195 | 0,5420 | 0,6819 | 0,5924 | 0,6329 | 0,6726 | 0,7605 |
| Hakkari | 0,5239 | 0,7610 | 0,4205 | 0,6486 | 0,5239 | 0,6687 | 0,5184 | 0,7209 |
| Hatay | 0,7556 | 0,7922 | 0,7682 | 0,8102 | 0,7556 | 0,8035 | 0,6830 | 0,7491 |
| Iğdır | 0,6914 | 1,0000 | 0,5815 | 1,0364 | 0,6914 | 1,0000 | 0,6547 | 1,0612 |
| Isparta | 0,7399 | 0,7469 | 0,5888 | 0,5952 | 0,7399 | 0,7595 | 0,4765 | 0,5008 |
| İstanbul | 1,0000 | 1,0000 | 1,9645 | Infeasible | 1,0000 | 1,0000 | 1,2507 | 1,4203 |
| İzmir | 0,8003 | 1,0000 | 0,7599 | Infeasible | 0,8003 | 1,0000 | 0,6413 | 1,0603 |
| Kahramanmaraş | 0,3730 | 0,4416 | 0,2955 | 0,2957 | 0,3730 | 0,4026 | 0,3782 | 0,4083 |
| Karabük | 0,9529 | 0,9823 | 0,9000 | 0,9111 | 0,9529 | 0,9784 | 0,6666 | 0,6695 |
| Karaman | 0,8166 | 0,8617 | 0,5353 | 0,5895 | 0,8166 | 0,8376 | 0,5486 | 0,5493 |
| Kars | 0,4161 | 0,5634 | 0,3545 | 0,5223 | 0,4161 | 0,4536 | 0,4510 | 0,5731 |
| Kastamonu | 1,0000 | 1,0000 | 1,2070 | 1,2070 | 1,0000 | 1,0000 | 1,0597 | 1,0597 |
| Kayseri | 1,0000 | 1,0000 | 0,3870 | 0,4003 | 1,0000 | 1,0000 | 0,4509 | 0,4815 |
| Kilis | 0,7612 | 1,0000 | 0,5791 | 1,3130 | 0,7612 | 1,0000 | 0,3747 | Infeasible |
| Kırıkkale | 0,5676 | 0,5836 | 0,4688 | 0,5020 | 0,5676 | 0,5700 | 0,5460 | 0,5475 |
| Kırklareli | 0,5930 | 0,8513 | 0,5334 | 0,5334 | 0,5930 | 0,7330 | 0,6543 | 0,7934 |
| Kırşehir | 0,8398 | 0,8835 | 0,6276 | 0,6847 | 0,8398 | 0,8646 | 0,5742 | 0,6492 |
| Kocaeli | 0,8505 | 0,8850 | 0,6579 | 0,6768 | 0,8505 | 0,8692 | 0,6769 | 0,6926 |
| Konya | 0,7840 | 1,0000 | 0,6295 | 1,1222 | 0,7840 | 1,0000 | 0,4758 | 1,0759 |
| Kütahya | 0,9718 | 1,0000 | 1,0504 | 1,1017 | 0,9718 | 1,0000 | 1,0586 | 1,0845 |
| Malatya | 1,0000 | 1,0000 | 0,6813 | 1,0528 | 1,0000 | 1,0000 | 0,5412 | 1,0336 |
| Manisa | 0,6665 | 0,7394 | 0,6643 | 0,6912 | 0,6665 | 0,7499 | 0,5990 | 0,6679 |
| Mardin | 0,4886 | 0,4999 | 0,4679 | 0,4737 | 0,4886 | 0,5018 | 0,5819 | 0,5819 |
| Mersin | 0,7999 | 0,8714 | 0,6902 | 0,6909 | 0,7999 | 0,8769 | 0,5689 | 0,5854 |
| Muğla | 0,6682 | 0,7075 | 0,6013 | 0,6343 | 0,6682 | 0,7310 | 0,5949 | 0,6607 |
| Muş | 0,4316 | 0,5302 | 0,3609 | 0,5025 | 0,4316 | 0,4603 | 0,4845 | 0,6055 |
| Nevşehir | 0,7699 | 0,7821 | 0,6829 | 0,6988 | 0,7699 | 0,7750 | 0,5444 | 0,5603 |
| Niğde | 1,0000 | 1,0000 | 0,6052 | 0,7100 | 1,0000 | 1,0000 | 0,4481 | 0,5545 |
| Ordu | 0,9213 | 1,0000 | 1,2091 | 1,2091 | 0,9213 | 1,0000 | 1,0593 | 1,0593 |
| Osmaniye | 0,5016 | 0,7471 | 0,4821 | 0,5265 | 0,5016 | 0,5843 | 0,4954 | 0,5686 |
| Rize | 0,8113 | 0,8228 | 0,7661 | 0,7661 | 0,8113 | 0,8506 | 0,7519 | 0,7803 |
| Sakarya | 1,0000 | 1,0000 | Infeasible | Infeasible | 1,0000 | 1,0000 | 1,2408 | 1,2449 |
| Samsun | 0,7462 | 0,8631 | 0,6952 | Infeasible | 0,7462 | 0,9051 | 0,7122 | 1,0904 |
| Şanlıurfa | 0,5325 | 0,5339 | 0,5537 | 0,5550 | 0,5325 | 0,5880 | 0,5806 | 0,6586 |
| Siirt | 0,3765 | 0,7905 | 0,3211 | 0,6027 | 0,3765 | 0,4001 | 0,3758 | 0,4109 |
| Sinop | 0,9685 | 1,0000 | 0,8834 | 1,0199 | 0,9685 | 1,0000 | 0,7910 | 1,0155 |
| Şırnak | 0,3221 | 0,5574 | 0,2726 | 0,4301 | 0,3221 | 0,3302 | 0,3402 | 0,3402 |
| Sivas | 0,7194 | 0,7362 | 0,6257 | 0,6728 | 0,7194 | 0,7647 | 0,6418 | 0,6555 |
| Tekirdağ | 0,9921 | 1,0000 | 0,7986 | 1,0338 | 0,9921 | 1,0000 | 0,7496 | 1,0789 |
| Tokat | 0,9955 | 1,0000 | 0,7902 | 0,8508 | 0,9955 | 1,0000 | 0,6781 | 0,6820 |
| Trabzon | 0,8881 | 1,0000 | Infeasible | Infeasible | 0,8881 | 1,0000 | 1,0321 | 1,0321 |
| Tunceli | 1,0000 | 1,0000 | 1,0052 | 1,1149 | 1,0000 | 1,0000 | 1,0049 | 1,1806 |
| Uşak | 0,9196 | 0,9835 | 0,6567 | 0,6746 | 0,9196 | 0,9806 | 0,5552 | 0,5959 |
| Van | 0,4976 | 0,5147 | 0,4859 | 0,4859 | 0,4976 | 0,6211 | 0,7042 | 0,7135 |
| Yalova | 1,0000 | 1,0000 | 1,4126 | 1,4445 | 1,0000 | 1,0000 | 1,1550 | 1,2986 |
| Yozgat | 0,9460 | 1,0000 | 1,2025 | 1,2025 | 0,9460 | 1,0000 | 1,0691 | 1,0691 |
| Zonguldak | 1,0000 | 1,0000 | 1,5011 | 1,5077 | 1,0000 | 1,0000 | 1,2350 | 1,2778 |

4. SONUÇ

İstenmeyen çıktıları dikkate alan geliştirilmiş Süper SBM modeli kullanılan bu çalışmada, 2015 yılı için Türkiye'deki illerin enerji verimliliği incelendi. Ampirik sonuçlar, 2015 yılında enerji verimliliğinin ilden ile hatta illerin bulunduğu bölgelerde bile önemli ölçüde değişiklikler göstermektedir.

Enerji verimliliğini etkileyen faktörler olan işletme ölçeği, endüstri yoğunluğu, sınai mülkiyet hakları yapısı ve devlet düzenlemeleri enerji verimliliği üzerinde önemli etkilere sahiptir ve bu faktörler belirgin etkilere neden olmaktadır. İşletme ölçeği enerji verimliliğinin önemli bir belirleyicisidir. Endüstri yoğunlaşması, enerji verimliliği ile olumlu yönde ilişkilidir; bu, yüksek endüstri yoğunluğunun, enerji verimliliğinin artırılmasına fayda sağladığını göstermektedir. Devlete ait sanayi kuruluşlarının daha fazla yenilenmesi, endüstriyel enerji verimliliğini artıracaktır. Ayrıca, doğrudan yabancı yatırımdaki artış ve enerji tüketim yapısındaki ayarlama, özellikle elektrik tüketim oranı arttığında, endüstriyel enerji verimliliğini artıracaktır. Bu nedenle, çeşitli endüstrilerin dikkatini ve gelişme durumlarını analiz etmeli ve etkileyen faktörleri ve düzenleme yöntemlerini farklı şekilde ele almalıyız. Bu arada, enerji verimliliğindeki iyileşmeler ile endüstriyel gelişmeler arasındaki ilişkiye yakından bakmak ve zaman içinde bu ilişkiyi düzeltmek gerekmektedir.

KAYNAKLAR

- Andersen, P., & Petersen, N. C. (1993). A procedure for ranking efficient units in data envelopment analysis. *Management science*, 39(10): 1261-1264.
- Balitskiy, S., Bilan, Y., Strielkowski, W., and Štreimikienė, D. (2016). Energy efficiency and natural gas consumption in the context of economic development in the European Union. *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 55: 156-168.
- Banker, R. D., Charnes, A., & Cooper, W. W. (1984). Some models for estimating technical and scale inefficiencies in data envelopment analysis. *Management science*, 30(9): 1078-1092.
- Banker, R. D., Chang, H., & Pizzini, M. J. (2004). The balanced scorecard: Judgmental effects of performance measures linked to strategy. *The Accounting Review*, 79(1): 1-23.
- Bian, Y., Hu, M., Wang, Y., & Xu, H. (2016). Energy efficiency analysis of the economic system in China during 1986–2012: a parallel slacks-based measure approach. *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 55: 990-998.
- Boyd, G. A., & Pang, J. X. (2000). Estimating the linkage between energy efficiency and productivity. *Energy policy*, 28(5): 289-296.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Charnes, A., Cooper, W. W., & Rhodes, E. (1978). Measuring the efficiency of decision making units. *European journal of operational research*, 2(6): 429-444.
- Charnes, A., Cooper, W. W., Golany, B., Seiford, L., & Stutz, J. (1985). Foundations of data envelopment analysis for Pareto-Koopmans efficient empirical production functions. *Journal of econometrics*, 30(1-2): 91-107.
- Charnes, A., Cooper, W. W., Seiford, L., & Stutz, J. (1982). A multiplicative model for efficiency analysis. *Socio-Economic Planning Sciences*, 16(5): 223-224.
- Charnes, A., Cooper, W. W., Seiford, L., & Stutz, J. (1983). Invariant multiplicative efficiency and piecewise Cobb-Douglas envelopments. *Operations Research Letters*, 2(3): 101-103.
- Charnes, A., Cooper, W. W., Learner, D. B., Phillips, F. Y., & Rousseau, J. (1987). Explicit Construction and Analysis of Some Efficient Empirical Production Functions in Data Envelopment Analysis (No. CCS-582). Texas Univ At Austin Center For Cybernetic Studies.
- Cooper, W. W., Ruiz, J. L., & Sirvent, I. (2007). Choosing weights from alternative optimal solutions of dual multiplier models in DEA. *European Journal of Operational Research*, 180(1), 443-458.
- Ediger, V. Ş., & Kentel, E. (1999). Renewable energy potential as an alternative to fossil fuels in Turkey. *Energy conversion and management*, 40(7): 743-755.
- Färe, R., Grosskopf, S., & Logan, J. (1983). The relative efficiency of Illinois electric utilities. *Resources and Energy*, 5(4): 349-367.
- Guyader, O., & Daures, F. (2005). Capacity and scale inefficiency: application of data envelopment analysis in the case of the French Seaweed fleet. *Marine Resource Economics*, 20(4): 347-365.
- Hepbasli, A., Ozdamar, A., & Ozalp, N. (2001). Present status and potential of renewable energy sources in Turkey. *Energy Sources*, 23(7): 631-648.
- Luong, N. D. (2015). A critical review on energy efficiency and conservation policies and programs in Vietnam. *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 52: 623-634.
- Martínez-Molina, A., Tort-Ausina, I., Cho, S., & Vivancos, J. L. (2016). Energy efficiency and thermal comfort in historic buildings: A review. *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 61: 70-85.
- Moya, D., Torres, R., & Stegen, S. (2016). Analysis of the Ecuadorian energy audit practices: A review of energy efficiency promotion. *Renewable and Sustainable Energy Reviews*, 62: 289-296.
- Tone, A. (2002). *Devices and desires: A history of contraceptives in America*. Macmillan.
- Zhu, J. (2014). *Quantitative models for performance evaluation and benchmarking: data envelopment analysis with spreadsheets (Vol. 213)*. Springer.

VERİ MADENCİLİĞİ İLE MÜŞTERİ KAYBI ANALİZİ

Dr. Öğr. Üyesi Ufuk ÇELİK*

ÖZET

Bu çalışmada veri madenciliği teknikleri ile müşteri kaybı analizi yapılmıştır. Analizi için IBM şirketi tarafından sunulan bir Telekom şirketine ait 7032 adet müşteri kaydında 20 farklı öz niteliği içeren veriler kullanılmıştır. Bir sınıflama problemi olan bu analizde müşterilerin şirketi terketme durumları tahmin edilmeye çalışılmıştır. Ayrıca müşterilerin şirketi terk etmesine sebep olan etkenler analiz edilmiştir. Tahminleme sonuçlarında %78 doğruluk oranı tespit edilmiştir. Müşteri kaybı analizinde en etkili öz niteliğin sözleşme olduğu gözlemlenmiştir.

Anahtar Kelimeler: veri madenciliği, iş analitiği, müşteri kaybı, tahmin

JEL Kodları: E37, D70, J63, C80

CUSTOMER CHURN ANALYSIS WITH DATA MINING

ABSTRACT

In this study, customer churn analysis was performed with data mining techniques. For the analysis, 7032 customers' records with 20 different attributes belonging to a Telecom company offered by IBM company were used. In this analysis, which is a classification problem, it is tried to estimate the cases of customers leaving the company. In addition, the factors causing customers to leave the company were analyzed. An accuracy rate of 79% was determined in the estimation results. It was observed that the most effective feature of the customer loss analysis was the contract.

Keywords: Data Mining, Business Analytics, Customer Churn, Forecasting

JEL Codes: E37, D70, J63, C80

1. GİRİŞ

Bir müşterinin veya bir ürün veya hizmetin kullanımını bırakması ihtimali üzerine geliştirilen analitik çalışmalar müşteri kayıp analizi (churn) olarak tanımlanır (Kılınç, 2018). Burada amaç müşterinin terk etme durumuna yaklaşımdan önce önleyici faaliyetlerde bulunmaktır. Terk etme

* Bandırma Onyedü Eylül Üniversitesi, Ö.S. Uygulamalı Bilimler Fakültesi, Yönetim Bilişim Sistemleri Bölümü
ucelik@bandirma.edu.tr

durumunu anlayıp müşteri kaybını önlemek için tahminleyici analizler yapılır. Bu analizler veri madenciliğinin bir alt koludur (Han, Kamber, & Pei, 2011). Analiz sonrasında terk etme ihtimali olan müşteriler insan kaynakları departmanı tarafından farklı yöntemlerle yeniden kazanılabilir. Yeni müşteri kazanma maliyeti ile eldeki müşterinin tutma maliyeti arasında büyük fark vardır.

Bir örgütün varlık nedeni olan müşterilerle karşılıklı fayda prensibine göre uzun vadeli bir ilişki kurmak anlamında geliştirilen Müşteri İlişkileri Yönetimi (MIY) sistemlerinin temelinde müşterilerden bilgi toplama, bilginin ilgili birimlere aktarımı, müşterinin alışkanlıklarının tespiti, müşterinin değerlerine riayet ve müşteri memnuniyetini artıracak operasyonların yürütülmesi gibi kavramlar karşımıza çıkar. MIY kapsamında yapılan bu teknoloji ve yönetim şeklindeki stratejik, operasyonel ve analitik çalışmalar sayesinde müşteri kayıplarının önüne geçilebilmektedir (Kaynar, Tuna, Görmez, & Deveci, 2017; Tsiptsis & Chorianopoulos, 2010).

Müşteri kayıp analizi için temelde kullanılan istatistiksel yaklaşımlar sahadan veri ambarına kadar toplanan tüm bilgileri (müşteri şikâyetleri, teknik destek raporları, anketler, kuruma itiraz vs.) analiz ederek sonuca varmayı hedefler (Şeker, 2016). Tüm bu verilerin analizi için günümüzde gelişmiş veri madenciliği yöntemleri (yapay sinir ağları, karar ağaçları, regresyon gibi) ve araçları (RapidMiner, Weka, KNime vb.) kullanılır. Başlangıçta bir istatistik yazılımı olan ancak gelişimi ile veri madenciliğinde önemli bir yer kazanan araçlardan birisi de R programlama dilidir.

Bu çalışmada R programlama dilinde temel bir karar ağacı algoritması ile müşteri kaybı analizi yapılmış ve sonuçlar incelenmiştir.

2. VERİ

Çalışmada kullanılan veriler IBM Şirketinin Watson Analytics sisteminde tanıtılan telekomünikasyon şirketi müşterilerin kaybı analizi için hazırlanan örnek veritabanından alınmıştır (Stacker, 2015). Şekil 1 ile özeti verilen veri setinde “Toplam Ücret” niteliğinde 11 adet boş veri olduğu için ayıklama yapılmış ve “Kullanım Hakkı” verileri sayısalardan gruplara ayrılarak kategorik hale getirilmiştir.

Şekil 2. Veri Özeti

```
Müşteri Kayıp Analizi Verileri 'data.frame': 7032 adet 21 öznitelik
$ Cinsiyet      : chr "Bayan" "Bay"
$ Yaşlı        : chr "Evet", "Hayır"
$ Ortaklık    : chr "Evet" "Hayır"
$ Muhtaçlık   : chr "Evet" "Hayır"
$ KullanımHakkıGrup : "0-12 Ay", "12-24 Ay", "24-48 Ay", "48-60 Ay", "> 60 Ay"
$ TelefonHizmeti : chr "Evet" "Hayır"
$ ÇokluHat     : chr "Telefon hizmeti yok" "Hayır" "Internet hizmeti yok"
$ InternetHizmeti : chr "DSL" "Fiber Optik" "Hayır"
$ ÇevrimiçiGüvenlik : chr "Evet" "Hayır"
$ ÇevrimiçiYedekleme: chr "Evet" "Hayır"
$ CihazKoruma  : chr "Evet" "Hayır"
$ TeknikDestek  : chr "Evet" "Hayır"
$ TelevizyonAkışı : chr "Evet" "Hayır"
$ FilmAkışı    : chr "Evet" "Hayır"
$ Sözleşme     : chr "Aylık" "Bir yıllık" "İki Yıllık"
$ KağıtsızFaturalama: chr "Evet" "Hayır"
$ ÖdemeYöntemi : chr "Elektronik Çek" "Eposta Çeki" "Banka Transfer (otomatik)"
$ AylıkÜcret   : num 29.9 57 53.9 42.3 70.7 ...
$ ToplamÜcret  : num 29.9 1889.5 108.2 1840.8 151.7 ...
$ Ayrılma     : chr "Evet" "Hayır"
```

3. YÖNTEM

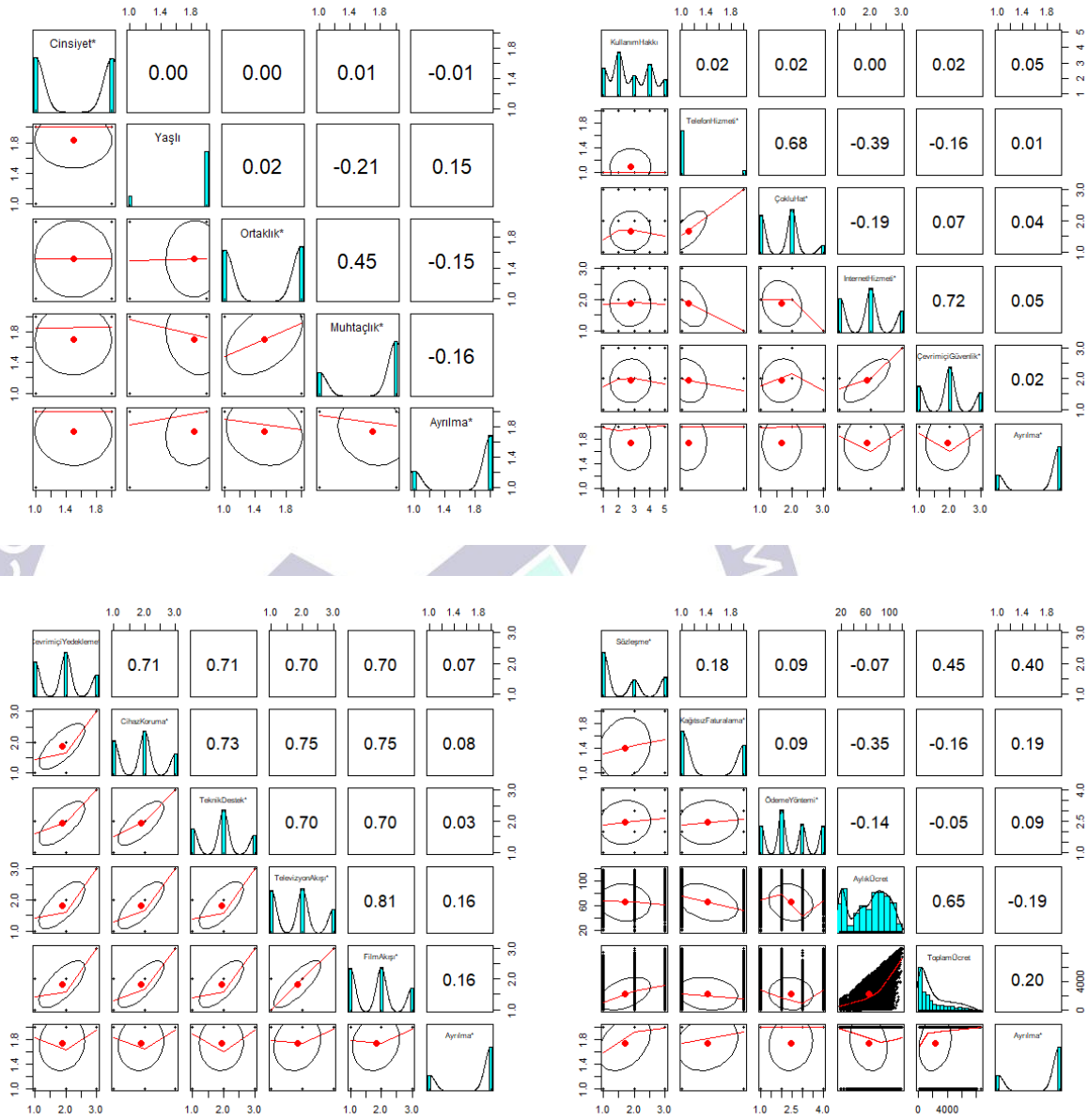
Bu çalışmada yöntem olarak karar ağacı algoritması kullanılmıştır (Quinlan, 1983, 1999). Bu denetimli öğrenme algoritmasının prensibi verilerin bir dizi karar kurallarına göre gruplara bölünmesidir. Hedef olarak gruptaki tüm verilerin aynı sınıf etiketine sahip olması gereklidir. Gruplara ayırma işlemi için farklı fonksiyonlar kullanılsa da en bilinen yöntem bilgi kazancı formülüdür (Cover & Thomas, 2006).

Çalışmada kullanılan açık kaynak kodlu R programlama dili kayıtları vektör, liste, veri çerçevesi gibi özel veri yapıları sayesinde ön tanımlı fonksiyonlar ile veriye bellek üzerinden doğrudan erişmek yerine sembol ve referanslarla kontrol eder (Ihaka & Gentleman, 1996; Özdemir vd., 2018; "The R Project for Statistical Computing", y.y.).

4. BULGULAR

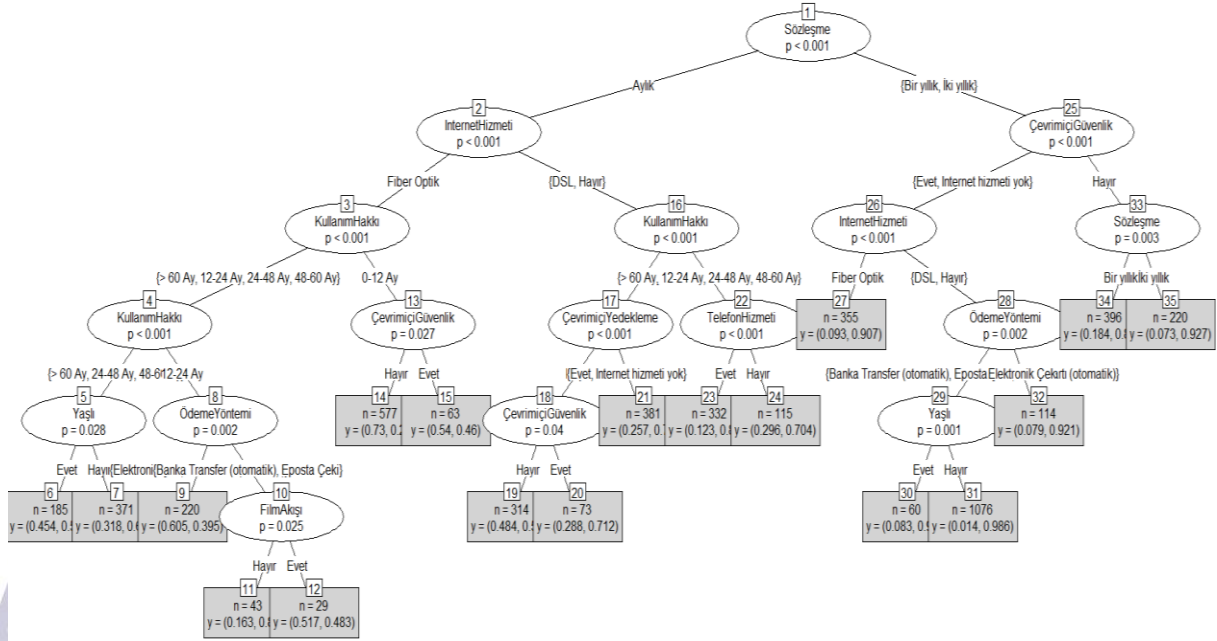
Veri temizliği sonrası sayısal bilgiler arasındaki korelasyonu anlamak için çizilen korelasyon grafiği Şekil 2 ile gösterilmiştir.

Şekil 2. Korelasyon grafikleri



Şekil 2 ile gösterilen detaylı korelasyon grafiğine göre “Aylık Ücret” ve “Toplam Ücret” arasında yüksek bir korelasyon vardır. Bu sebeple analizde bir tanesinin kullanılması yeterli olacağı için “Toplam Ücret” değerinin veri setinden kaldırılabilir.

Şekil 3. Karar Ağacı



Şekil 3 ile gösterilen karar ağacı grafiğine göre “Sözleşme” en önemli belirleyici faktöre olarak karşımıza çıkmaktadır.

Tablo 1. Karar Ağacı Karşılaştırma Matrisi

| Ayrılma | Gerçek | |
|----------------|--------|--------|
| | Evet | Hayır |
| Tahmin | | |
| Evet | 240 | 146 |
| Hayır | 320 | 1402 |
| Doğruluk Oranı | | 0,7789 |

5. SONUÇ VE TARTIŞMA

Müşteri kaybı analizi için yapılan bu çalışmada veriler temizlendikten ve sayısal bilgiler kategorize edildikten sonra, korelasyon grafiği ile ilişkili veriler tespit edilmiştir. Toplam 7032 adet kayıttan 1869 müşterinin şirketi terk ettiği anlaşılmaktadır. Veri madenciliğinde denetim bir öğrenme yöntemi olan karar ağacı algoritması ile analiz yapılarak sonuçlar vurgulanmıştır.

Karar ağacı analizden elde edilen ve Tablo 1'e göre gösterilen doğruluk oranı %77.89 bulunmuştur. Karar ağacı ile Telekom şirketinin müşteri kaybetmesindeki en önemli faktörün “Sözleşme” olduğu anlaşılmıştır. Aylık sözleşme yapanlar içinden “İnternet Hizmeti” ile yıllık sözleşme yapanların ise “Çevrim içi Güvenlik” konusunda ayrıldıkları görülmektedir.

REFERANSLAR

- Cover, T. M., and Thomas, J. A. (2006). *Elements of Information Theory*, 2nd Edition. Willey.
- Han, J., Kamber, M., and Pei, J. (2011). *Data Mining: Concepts and Techniques* 3rd Edition. Morgan Kaufmann Publishers.
- Ihaka, R., & Gentleman, R. (1996). R: a language for data analysis and graphics. *Journal of Computational and Graphical Statistics*, 5(3): 299–314.
- Kaynar, O., Tuna, M. F., Görmez, Y., & Deveci, M. A. (2017). Makine öğrenmesi yöntemleriyle müşteri kaybı analizi. *Cumhuriyet Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi*, 18(1): 1–14. Tarihinde adresinden erişildi <http://dergipark.gov.tr/cumuiibf/issue/32216/357723>
- Kılınc, D. (2018). Müşteri Kayıp (Churn) Analizi. *İçinde Uygulamalarla Veri Bilimi*: 84–89. Abaküs.
- Özdemir, A. F., Yıldıztepe, E., Binar Dokuz, M., Üniversitesi, E., Fakültesi, F.-E., & Bölümü, İ. (2018). İstatistiksel Yazılım Geliştirme Ortamı: R.
- Quinlan, J. R. (1983). *Learning Efficient Classification Procedures and Their Application to Chess End Games* BT - *Machine Learning: An Artificial Intelligence Approach*. İçinde R. S. Michalski, J. G. Carbonell, & T. M. Mitchell (Ed.) (ss. 463–482). Berlin, Heidelberg: Springer Berlin Heidelberg. https://doi.org/10.1007/978-3-662-12405-5_15
- Quinlan, J. R. (1999). Simplifying decision trees. *International Journal of Human-Computer Studies*, 51(2): 497–510. <https://doi.org/10.1006/IJHC.1987.0321>
- Şeker, S. E. (2016). Müşteri Kayıp Analizi (Customer Churn Analysis). *YBS Ansiklopedi*, 3(1), 26–29. Tarihinde adresinden erişildi http://ybsansiklopedi.com/wp-content/uploads/2016/06/musteri_kayip.pdf
- Stacker, M. (2015). Using Customer Behavior Data to Improve Customer Retention. Tarihinde 01 Kasım 2018, adresinden erişildi <https://www.ibm.com/communities/analytics/watson-analytics-blog/predictive-insights-in-the-telco-customer-churn-data-set/>
- The R Project for Statistical Computing. (y.y.). Tarihinde 01 Kasım 2018, adresinden erişildi <https://www.r-project.org>
- Tsiptsis, K., & Chorianopoulos, A. (2010). *Data Mining Techniques in CRM: Inside Customer Segmentation*. John Wiley & Sons, Ltd. Willey. <https://doi.org/10.1002/9780470685815>

**DEĞİŞİME HAZIR OLMA: HAVALİMANI ÇALIŞANLARINA YÖNELİK BİR ALAN
ARAŞTIRMASI**

Meltem AKCA*

ÖZET

Organizasyonlar sürdürülebilir performans elde etmek için stratejik kararlarını genellikle teknolojik ve çevresel değişim yaklaşımları ile uyumlu olarak planlarlar. Organizasyonlar gibi havalimanı operatörleri de çevresel değişim süreçlerini yakından takip eder. Be nedenle “değişim” havalimanı sektörü için önemli bir unsurdur. Organizasyonlar daha iyi performans çıktıları elde etme beklentisi ile değişime odaklanmaktadır. Ayrıca çalışanların değişime yönelik algılarının değişim operasyonlarının başarısı üzerinde önemli bir etkisi vardır. Çalışanların örgütsel değişime yönelik duygusal, davranışsal ve psikososyal durumları “Değişime Hazır Olma” kavramı ile ölçülmektedir (Weiner, Amick & Lee, 2008). Değişime hazır olma; bu değişimin örgütsel ve bireysel gelişim üzerinde pozitif ve iyi etkilerinin olacağına yönelik değişimi kabul etme düzeyi olarak tanımlanmaktadır (Kirrane vd., 2016; Bouckenoghe, 2010).

Bu çalışmada İstanbul Atatürk Havalimanı'ndaki A grubu ruhsat sahibi yer hizmetleri işletmesi çalışanlarının İstanbul Yeni Havalimanına geçiş sürecindeki değişime hazır olma düzeylerinin ölçülmesi amaçlanmıştır. Bu amaç doğrultusunda Değişime Hazır Olma Ölçeği (Bouckenoghe vd., 2009) kullanılmıştır. Ayrıca soru formunda demografik değişkenlere ilişkin ifadeler de bulunmaktadır. Ölçeğin faktöriyel yapısı LISREL 8.8 Programı ile test edilecektir. Ayrıca demografik sorulara ilişkin gruplar arası farklılıkların tespitinde IBM İstatistik SPSS 21.00 programı kullanılacaktır. Kolayda örnekleme yöntemi ile 1000 çalışana dağıtılan anket formlarının elde edilmesi sonucunda analizler gerçekleştirilecek ve veriler yorumlanacaktır.

Anahtar Kelimeler: *Havalimanları, Değişime Hazır Olma, Yatırımlar, İstanbul Yeni Havalimanı*

JEL Kodları: *M12, M54, L91*

* İstanbul Üniversitesi, Ulaştırma ve Lojistik Fakültesi, İstanbul, meltemy@istanbul.edu.tr

ABSTRACT

Organisations generally plan their strategic decisions accordance with technological and environmental change approaches to have a sustainable performance. As organisations, airport operators also follow environmental alteration processes. Therefore, “change” is a significant concept for airport sector. Organisations focus on “change” to expect better performance outcomes. Otherwise, employees’ perception about the “change” has an important impact on change operation’s success. Employees intentional, behavioural and psychological preparation for organisational change is measured with readiness for change concept (Weiner, Amick & Lee, 2008). Readiness for change is identified as the employees’ acceptance level for change which means it is a good and positive component for organisational and individual progress (Kirrane et al., 2016; Bouckennooghe, 2010).

In this study it is aimed to measure Istanbul Atatürk Airport’s A group certificated ground handling company employees’ readiness for change level in the process of movement to Istanbul New Airport. For this purpose, it is used of Readiness for Change Scale (Bouckennooghe et al, 2009). In the questionnaire form, it is also used demographic items. Factorial structure of the scale will be analysed through LISREL 8.8 Scientific Software International Programme. Besides, it is expected to use IBM Statistics SPSS 21.00 Programme to reveal out the differences between groups. 1000 questionnaire forms sent to employees with the convenience sampling method. Accordance with acquired forms, it is tried to analyse datas and mention the findings of the study.

Keywords: Airports, Readiness for Change, Investments, Istanbul New Airports

Jel Codes: M12, M15, L91

1. GİRİŞ

Günümüz iş hayatının rekabetçi ve dalgalı yapısı pek çok işletmenin çevresel değişimler ile uyumlu olması zorunluluğunu ön plana çıkarmaktadır. Bilgi teknolojilerinin gelişmesi, örgüt yapılarının değişmesi, müşteri taleplerinin farklılaşması bu süreçte etkili olmaktadır. Piyasa koşulları da örgütleri sürdürülebilir performans sağlamak için yeni arayışlara yönlendirmektedir. Bu nedenle pek çok lider ve yönetici için “değişim” piyasada var olmak için zaruri bir kavram olarak dikkat çekmektedir. Bu araştırmada İstanbul Atatürk Havalimanı çalışanlarının İstanbul Yeni Havalimanı’na taşınma sürecine yönelik değişime hazırlık algılarının ortaya çıkarılması amaçlanmıştır. İstanbul Atatürk Havalimanı, mevcut yapısı ile kapasite taleplerini karşılamakta güçlük çekmekte ve uçuş operasyonlarında havada ve yerde beklemlerin çözümünde yetersiz kalmaktadır. Yeni inşa edilen meydana kapasite artırıcı

yatırımların yanı sıra operasyonel faaliyetlerde kolaylık sağlayacak bilgi teknolojileri uygulamalarından da daha yoğun bir şekilde yararlanılması beklenmektedir.

Bu araştırmada İstanbul Atatürk Havalimanı'nda faaliyet gösteren A Grubu yer hizmetleri ruhsatı sahibi bir işletmenin çalışanlarının “Değişime Hazır Olma” seviyelerinin ölçülmesi amaçlanmıştır. Değişime Hazır Olma kavramının örgütlerde gerçekleştirilecek tüm değişim faaliyetlerinde çalışan verimliliğinin sağlanması için değerlendirilmesi gereken bir unsur olduğunun vurgulanması ve değişim başarısının sağlanmasında çalışanların hazır hale getirilmesinin de önemli olduğunun belirtilmesi hedeflenmiştir.

2. KAVRAMSAL ÇERÇEVE

Değişime hazır olma, çalışanların davranışsal, bilişsel ve psikolojik olarak planlanan değişime hazır olmasıdır. Çalışanların değişime hazır olma düzeyinin artmasında bu değişimin bireysel ve örgütsel performansın sağlanmasında önemli bir ihtiyaç olarak görülmesinin katkısı büyüktür (Weiner, Amick ve Lee, 2008). Değişime hazır olma, örgüt üyelerinin bu değişimin gerekli olduğuna yönelik olumlu ve istekli düşünceleridir (Kirrane vd., 2016). Bouckeenoghe ve arkadaşlarına göre (2009) değişime hazır olmanın üç boyutu vardır. Bunlar, duygusal hazırlık, bilişsel hazırlık ve niyetsel hazırlıktır. Değişimin nasıl başlatılacağına yönelik düşünceler duygusal hazırlık kapsamındadır. Değişim planlarındaki çalışan düşünceleri de duygusal hazırlık boyutu altında ele alınmaktadır. Çalışanların değişim çıktılarına yönelik beklenti ve tutumları da bilişsel hazırlık boyutunu meydana getirmektedir. Son olarak, niyetsel hazırlık ise çalışanların değişim ve değişim uygulamalarına yönelik istekli ve hevesli olmasını ifade etmektedir. Çalışanların değişimden beklediği olumlu çıktıların elde edilmesi için çaba göstermesi ve enerji harcaması da niyetsel hazırlık kapsamında ele alınmaktadır (Kirrane vd., 2016; Zayim ve Kondakci, 2015; Simon, 1996).

Değişime hazır olma düzeyinin belirlenmesi değişime karşı direnç olup olmayacağının da bir göstergesi olarak kabul edilmektedir. Hazır olma düzeyi yüksek çalışanların değişimi desteklemesi beklenmektedir. Böyle bir durumda hem değişim uygulamasına yönelik başarı artacak hem de değişimden beklenen çıktılar daha kaliteli gerçekleşecektir. Çalışanların değişime hazır olmasının sağlanmasında değişime yönelik gerekliliklerin iyi bir şekilde anlatılması, değişime yönelik uygulamaların açıklığa kavuşturulması, değişim için çalışanların ihtiyaç duyduğu gerekliliklerin yerine getirilmesi önem arz etmektedir (Armenakis vd., 1993). Çalışanların değişim konusunda eğitilmesi, desteklenmesi ve ihtiyaç duydukları unsurların belirlenip onlara yardımcı olunması gerekmektedir. Motivasyon, liderlik, örgütsel destek değişim sürecinde çalışan algısı ve tutumu üzerinde etkili olacak faktörler olarak ele alınmaktadır (Bouckeenoghe, 2012).

Çalışanlar değişim sonucu ortaya çıkacak yapı ile kendi yetkinliklerinin uyumlu olduğuna inanırsa değişime yönelik direnç azalacaktır. Bu nedenle çalışanları değişime hazır hale getirmek oldukça önemlidir. Çalışanların değişime hazır olma düzeylerinin oluşmasında örgüt içi sosyal ilişkiler, bireysel faktörler de etkili olmaktadır(Woodman, Sawyer ve Griffin, 1993). Örgütsel ve bireysel hedefler arası uyumun sağlanması değişime hazır olma düzeyinin de arttırılmasında etkili olacaktır(Fox vd., 1988).

3. METODOLOJİ

3.1. Araştırmanın Yöntemi

Bu araştırmanın amacı A grubu yer hizmetleri ruhsatı sahibi bir işletmenin çalışanlarının İstanbul Atatürk Havalimanı'ndan İstanbul Yeni Havalimanı'na taşınma sürecindeki değişime hazır olma düzeylerini belirlemektir. Ayrıca soru formunda yer alan demografik değişkenlere göre gruplar arası anlamlı farklılık olup olmadığının da test edilmesi hedeflenmiştir. Araştırmanın amacını gerçekleştirmek için hazırlanan soru formunda Bouckeenoghe ve arkadaşları (2009) tarafından geliştirilen “Değişime Hazır Olma” ölçeği kullanılmıştır. Kolayda örnekleme yöntemi ile 1000 çalışana anketler gönderilmiş ve elde edilen 379 anket üzerinde analizler yapılmıştır. Araştırma kapsamında IBM Statistics SPSS 21.00 programı ve Lisrel 8.8 Scientific Software International programlarından yararlanılmıştır.

H₁: Değişime hazır olma düzeyinde cinsiyete göre gruplar arası istatistiksel olarak anlamlı fark vardır.

H₂: Değişime hazır olma düzeyinde yaşa göre gruplar arası istatistiksel olarak anlamlı fark vardır.

H₃: Değişime hazır olma düzeyinde eğitim durumuna göre gruplar arası istatistiksel olarak anlamlı fark vardır.

H₄: Değişime hazır olma düzeyinde medeni duruma göre gruplar arası istatistiksel olarak anlamlı fark vardır.

3.2. Araştırma Bulguları

379 yer hizmetleri çalışanından elde edilen verilerin normallik testleri yapılmış ve verilerin parametrik analizler için uygun olduğu saptanmıştır. Araştırmada kullanılan ölçeğin güvenilirliği Cronbach Alpha's katsayısı ile değerlendirilmiştir. Değişime hazır Olma ölçeği iç tutarlılık katsayısı 0.81 olarak tespit edilmiştir. Değişime hazır olma ölçeği alt boyutlarının iç tutarlılık katsayıları

incelendiğinde; duygusal hazırlık boyutu 0.83, bilişsel hazırlık boyutu 0.87, niyetsel hazırlık boyutu ise 0.80 olarak hesaplanmıştır. 0.70 ve üzeri olan değerlerin tutarlı olarak kabul edildiği göz önüne alındığında araştırmada kullanılan ölçeğin ve alt boyutların güvenilir olduğu sonucuna ulaşılmaktadır. Araştırmada kullanılan ölçek ortalaması ise 3.87'dir. Bu rakam çalışanların değişime hazır olma düzeylerinin ortalama üzerinde olduğunu göstermektedir. Yapılan doğrulayıcı faktör analizi sonucunda da ölçeğin yapı geçerliliği test edilmiş ve uyum katsayısının kabul edilebilir düzeyde olduğu tespit edilmiştir.

Tablo 1. Doğrulayıcı Faktör Analizi Sonuçları

| | χ^2 | df | χ^2/df | RMSEA | TLI | IFI | CFI | Faktör Yükleri |
|--------------------------|----------|----|-------------|-------|------|------|------|----------------|
| Değişime Hazırlık Ölçeği | 287.42* | 79 | 3.63 | 0.06 | 0.94 | 0.92 | 0.90 | 0.58-0.82 |

Araştırma hipotezlerinin test edilmesinde gruplar arası farklılıkların tespiti için Farklılık Analizleri yapılmıştır. Bağımsız örneklem T Testi sonuçlarına göre erkek çalışanların değişime hazır olma düzeyleri kadın çalışanların hazır olma düzeylerinden daha yüksek çıkmıştır. Ayrıca Varyans Analizi sonuçlarına göre de bekâr çalışanların değişime hazır olma düzeyleri evli ve boşanmış çalışanların değişime hazır olma düzeylerinden daha yüksektir. Eğitim durumu ve yaş değişkenlerine göre gruplar arası istatistiksel olarak anlamlı bir fark tespit edilmemiştir.

4. SONUÇ

Günümüz organizasyonları varlıklarını devam ettirebilmek için değişim odaklı olmak zorundadır. Havalimanları da pek çok organizasyonun bir arada olduğu büyük bir yapıdır. İstanbul Atatürk Havalimanı'nın havacılık sektörü gelişimi karşısında artan talebe yetecek altyapı ve arazi genişleme kapasitesinin olmaması İstanbul için yeni bir meydan yapımını zorunlu kılmıştır. Bu kapsamda inşa edilen İstanbul Yeni Havalimanı artan havayolu talebine cevap verecek şekilde çok daha gelişmiş teknolojiler ile donatılmıştır. İstanbul Atatürk Havalimanı'ndaki mevcut bilişim sistemlerinin yanı sıra yolcu ve çalışan entegrasyonunu arttıracak yeni sistemler ile geliştirilmiştir. Bu kapsamda yeni meydana operasyonların başlaması ile birlikte hem yolcular hem çalışanlar için büyük değişiklikler meydana gelecektir. Tüm bunların yanı sıra yeni meydana taşınma süreci başlı başına bir değişim uygulamasıdır. Çalışanların iş ile ilgili operasyonlarına yönelik değişimlerin yanı sıra barınma, ulaşım, yeme-içme gibi pek çok ihtiyaç planlamasında da değişimler yaşanması beklenmektedir. Bu araştırmada yer hizmetleri işletmesi çalışanlarının değişime hazır olma düzeylerinin ortaya çıkarılması amaçlanmış ve hazır olma düzeyinin ortalamanın üzerinde olduğu tespit edilmiştir. İlgili otoritelerin değişim planlamasına yönelik uygulamaları, eğitimler değişime hazır olma düzeyini arttıran faktörler olarak dikkat çekebilmektedir. Ayrıca araştırma sonuçlarına göre birinci ve dördüncü hipotezler kabul

edilmiştir. Bekâr çalışanların değişime hazır olma ortalamaları (3.92), evli ve boşanmış çalışanların hazır olma ortalamalarından daha yüksektir. Son olarak kadın çalışanların değişime hazır olma ortalamasının da erkek çalışanların değişime hazır olma ortalamasından daha düşük olduğu ortaya çıkarılmıştır. Kadınların anne olma rolü, aile hayatına ilişkin roller önemli değişikliklerde ön planda tuttuğu etmenler olarak ele alınabilmektedir. Aynı şekilde bekâr olma durumu da bireysel roller üzerinde esneklik tanıyacak bir faktör olarak düşünülebilir. İlerleyen araştırmalarda değişime hazır olma düzeyi ve değişim başarısı arasındaki ilişkileri inceleyecek ampirik araştırmaların geliştirilmesi literatüre katkı sağlayacaktır.

KAYNAKÇA

- Armenakis, A. A., Harris, S. G., & Mossholder, K. W. (1993). Creating readiness for organizational change. *Human relations*, 46(6), 681-703.
- Bouckenooghe, D. (2010). Positioning change recipients' attitudes toward change in the organizational change literature. *The Journal of Applied Behavioral Science*, 46(4), 500-531.
- Bouckenooghe, D. (2012). The role of organizational politics, contextual resources, and formal communication on change recipients' commitment to change: A multilevel study. *European Journal of Work and Organizational Psychology*, 21(4), 575-602.
- Bouckenooghe, D., Devos, G., & Van den Broeck, H. (2009). Organizational change questionnaire—climate of change, processes, and readiness: Development of a new instrument. *The Journal of psychology*, 143(6), 559-599.
- Fox, D. G., Ellison, R. L., & Keith, K. L. (1988). Human resource management: An index and its relationship to readiness for change. *Personnel Administration*, 17(3), 297-302.
- Kirrane, M., Lennon, M., O'Connor, C., & Fu, N. (2017). Linking perceived management support with employees' readiness for change: the mediating role of psychological capital. *Journal of Change Management*, 17(1), 47-66.
- Simon, N. J. (1996). Organizational development: Meeting the challenge of change: The issue of readiness. *Competitive Intelligence Review*, 7(2), 86-88.
- Weiner, B. J., Amick, H., & Lee, S. Y. D. (2008). "Conceptualization and Measurement of Organizational Readiness for Change: a Review of the Literature in Health Services Research and Other Fields". *Medical Care Research and Review*, 65(4), 379-436.
- Woodman, R.W., Sawyer, J.E. and Griffin, R.W. (1993). "Towards a Theory of Organizational Creativity", *Academy of Management Review*, 18(2): 293-321.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Zayim, M., and Kondakci, Y. (2015). “An Exploration of The Relationship between Readiness for Change and Organizational Trust in Turkish Public Schools”. *Educational Management Administration & Leadership*, 43(4): 610-625.



BORSA İSTANBUL'DA SÜRÜ DAVRANIŞINI TEST ETMEYE YÖNELİK

AMPİRİK BİR ANALİZ

Doç. Dr. Ali BAYRAKDAROĞLU*

Arş. Gör. Dr. Yusuf TEPELİ**

ÖZET

Bireylerin yatırım kararları verirken her zaman rasyonel davranmadıkları, irrasyonel davranışlar da sergiledikleri bilinmektedir. Piyasanın etkisi ile bireyin kararlarını revize ederek piyasaya paralel kararlar vermesi sürü davranışı olarak adlandırılmaktadır. Sermaye piyasalarında sürü davranışının görülmesi fiyatların doğru bir şekilde oluşmasını engellemekte ve bu durum piyasaların etkinliğini bozmaktadır. Bu bağlamda çalışmada, BİST-30 endeksinde piyasa yönünde sürü davranışının varlığı araştırılmıştır. Araştırma kapsamında 04.01.2016 ile 24.10.2018 dönemindeki BİST-30 endeksinde işlem gören 30 firmanın günlük getirileri kullanılmıştır. Piyasanın aşırı yükseldiği ve düştüğü günlerde, pozitif ve negatif olarak %1, %5 ve %10'luk uç bölgeye denk gelen getiri oranlarının yaşandığı günler piyasada stresin yaşandığı günler olarak kabul edilmiştir. Christie ve Huang tarafından geliştirilen yatay kesit standart sapma (CSSD) yöntemine dayanarak yapılan analizler sonucunda; %1, %5 ve %10'luk uç değerler dikkate alındığında ilgili dönemde yatırımcının sürü davranışı sergilemediği tespit edilmiştir.

Anahtar Kelimeler: *Sürü Davranışı, Yatay Kesit Değişkenlik, BİST-30, Christie ve Huang (1995)*

Jel Kodları: *G1, G14, G40*

AN EMPIRICAL ANALYSIS FOR TESTING HERD BEHAVIOR

IN BORSA ISTANBUL

ABSTRACT

It is known that individuals not only behave rational, but also act irrational while they make investment decisions. If an individual make parallel decision to the market by revising his decisions with the effect of market, it is named as herd behavior. The existence of herd behavior in capital markets prevents the occurrence of correct prices. In this context, this study examines the existence of herding behavior in the direction of market in BIST-30 index. Within the research, daily returns between 04.01.2016 and 24.10.2018 period of 30 firms, which are traded in BIST-30 index, were used. In the

* Muğla Sıtkı Koçman Üniversitesi, İ.İ.B.F. İşletme Bölümü, 48170 Kötekli, Muğla, Türkiye, abayrakdaroglu@mu.edu.tr.

** Muğla Sıtkı Koçman Üniversitesi, İ.İ.B.F. İşletme Bölümü, 48170 Kötekli, Muğla, Türkiye, yusuftepel@mu.edu.tr.

days when market was extremely high and extremely low, return rates on the days corresponded to positively and negatively 1%, 5% and 10% extreme region were assumed as stressful days in the market. As a result of cross section standard deviation (CSSD) analysis developed by Christie and Huang, when 1%, 5% and 10% extreme regions are considered, it is concluded that investors do not exhibit her behavior in related period.

Keywords: *Herd Behavior, Cross Sectional Deviation, BIST-30, Christie ve Huang (1995)*

Jel Kods: *G1, G14, G40*

1. GİRİŞ

Geleneksel finans teorilerine göre yatırımcılar ellerindeki finansal bilgiyi kendi çıkarları doğrultusunda kullanarak üstlendikleri riskleri en aza indirmeye çalışırken, elde edecekleri getiriye ise artırmak gayretindedirler. Dolayısıyla piyasaların etkinliği açısından yatırımcıların kararlarında rasyonel davrandıkları düşünülmektedir (Doğukanlı ve Ergün, 2011: 227). Bir başka ifade ile insan faktörü teorik açıdan mükemmel olarak kabul edilmektedir. Fakat yatırımcıların her zaman sahip olduğu finansal bilgileri tam anlamıyla kullanmadığı, değer yargıları ve sezgilerinden de yararlanarak irrasyonel davranışlar sergiledikleri görülmektedir (Işık, 2018: 1). Kahneman ve Tversky (1979) çalışmalarında yatırımcıların kazanç ve kayıplara farklı olasılık düzeylerinde farklı ağırlıklar yüklediklerini, bu nedenle de yatırımcının algılanan riske beklenen riskten daha fazla önem verdiğini dolayısıyla duyguları ve bakış açısı gibi güdülerinin karar verme sürecini etkilediğini ortaya koyarak bu durumu “Davranışsal Finans” olarak adlandırmışlardır. Özellikle karar verme sürecinde, bireyin irrasyonel olması konusunda bilişsel ön yargılar gibi bireysel nedenlerin yanında, mensubu olunan grubun yaklaşımları da etkili olabilmektedir. Dahil olunan grubun etkisi ile yatırımcının kararlarını revize etmesi ve gruba paralel kararlar vermesi, sürü davranışı olarak adlandırılmaktadır (Doğukanlı ve Ergün, 2015: 8). Ancak yatırımcıların sergilemiş oldukları her davranış sürü davranışı olarak nitelendirilememektedir. Bir davranışın sürü davranışı olarak nitelendirilebilmesi için temel koşul, yatırımcının kendi başına almış olduğu yatırım kararını, diğer yatırımcıların kararından etkilenecek şekilde değiştirmesidir (Decamps ve Lovo, 2002: 3).

Temel amacı kar ve fayda maksimizasyonu olan bir yatırımcının, diğer yatırımcıların kararlarını öğrendikten sonra kişisel kararlarını değiştirmesinin üç temel nedeni vardır. Bunlardan ilki, diğer yatırımcıların yatırım getirileri hakkında farklı bilgiye sahip oldukları inancı, ikincisi diğer yatırımcıların tercihlerine uyma konusunda içsel tercihlerin olması iken üçüncüsü ise, profesyonel portföy yöneticilerinin performanslarının ve ücretlerinin piyasanın geneline göre değerlendirilecek olması sebebiyle yanılma riskinden uzaklaşma çabasıdır (Bikhchandani ve Sharma, 2001: 280). Ancak yatırımcıların aynı kararları almaları ve aynı işlemleri gerçekleştirmeleri daha önce de ifade edildiği gibi her zaman sürü davranışının olduğu anlamına gelmemektedir. Piyasaya yeni gelen bilgiler

doğrultusunda yatırımcının kararını değiştirmesi, rasyonel yatırımcının yeni bilgiyi doğru analiz etmesinden kaynaklandığından “sahte sürü davranışı” olarak adlandırılmaktadır. Bu nedenle sahte sürü davranışını gerçek sürü davranışından ayrı tutmak gerekmektedir (Altay, 2008: 29). Sahte sürü davranışında alınan kararlar, benzer bilgiye, benzer yatırım stratejisi ve benzer risk yaklaşımına dayandığı için etkin bir kararı ifade etmektedir.

Hisse senedi piyasalarındaki büyük fiyat hareketlerinde ve bu fiyatların istikrarsız hale gelmelerinin arkasında kurumsal yatırımcıların sürü davranışlarının olduğuna dair literatürde güçlü kanıtlar mevcuttur (Chen, 2002: 4). Bu nedenle piyasalardaki sürü davranışının varlığını tespit etme çabaları oldukça önem kazanmıştır. Bu doğrultuda piyasalarda sürü davranışını ölçmeye yönelik birçok model geliştirilmesine rağmen halen kullanılabilen uygulamalı ölçüm modelleri yalnızca üç tanedir. Bunlardan ilki LSV (Lakonishok, Schleifer, Vishny) ölçüm yöntemidir. Bu yöntemde sürü davranışı ölçümü geçmişteki pay senedi performansı ile belirlenmektedir. Fakat yeni ortaya çıkan bir bilginin talep esnekliğine ait kesinleşmiş ve doğru bilgi bulunmadan sürü davranışının etkisini ölçmek çok zordur (Kıyılar ve Akkaya, 2016: 221). Ayrıca yöntem pay senetlerinin parasal tutarlarını dikkate almadan yalnızca yatırımcı sayısını dikkate alarak sürü psikolojisini ölçmeye çalışması bakımından literatürde oldukça eleştirilmiştir (Çoban, 2009: 47).

Bu eleştirilere yanıt olarak Christie ve Huang (1995) ile Chang, Cheng ve Khorana (2000) varlık getiri oranlarının yatay kesit değişkenliği ile piyasa getiri oranı arasındaki ilişkiden yararlanarak sermaye piyasalarında sürü davranışı varlığının belirlenebileceğini ileri sürmektedirler. Bunun için de genellikle aşırı fiyat artışlarının veya düşüşlerinin olduğu dönemleri kullanmışlardır. Ortaya koydukları modelde aşırı yükseliş ve aşırı düşüşlerin olduğu dönemler kukla değişkenler yardımıyla regresyona tabi tutulmuş, bu regresyon denkleminde elde edilen negatif ve istatistiksel olarak anlamlı katsayılar sürü davranışının varlığına delil olarak kabul edilmiştir (Ulzii, Moslehpour ve Kien, 2018). Bu modele alternatif olarak geliştirilen bir başka model ise Hwang ve Salmon (2004) tarafından ortaya atılmıştır. Modelde piyasanın stres altında olmasının her zaman aşırı yüksek ya da düşük getiri oranlarına neden olmayabileceğini, bu nedenle aşırı yüksek ve düşük şekilde kukla değişkenler kullanmanın subjektif bir yargı doğruluğunu ifade etmişlerdir. Dolayısıyla modelin net bir sonuç vermeyeceği öne sürülmüş, sermaye piyasalarındaki sürü davranışını finansal varlık fiyatlama modelinden yola çıkarak pay senedi beta katsayılarının yatay kesit standart sapması ve betasıyla analiz etmenin daha doğru sonuçlar vereceğini belirtmişlerdir. Her üç yöntemin amacı temelde pay piyasalarında sürü davranışını tespit etmek olsa da aynı borsada aynı yöntemi kullanan araştırmacıların bile farklı sonuçlar elde edebiliyor olması konuyu daha da ilginç hale getirmiştir. Bu bağlamda bu çalışmada BIST30 Endeksinde yer alan şirketlere ilişkin menkul kıymetlerin getiri oranları incelenmiş ve Christie ve Huang (1995)'in geliştirmiş oldukları model yardımıyla sürü davranışının olup olmadığının tespit edilmesi amaçlanmıştır.

2. METODOLOJİ

Sermaye piyasalarında yatırımcıların sürü davranışı göstermesi, piyasadaki varlıkların fiyatlarının doğru bir şekilde oluşmasına engel olmakta ve kısa vadede piyasaların etkinliğini bozmaktadır. Bu durum beraberinde oynaklığı ve kırılabilirliği getirmekte ve nihayetinde ekonomiyi olumsuz etkilemektedir (Kıyılar ve Akkaya, 2016: 203-204). Bu bağlamda araştırmanın temel motivasyonu Borsa İstanbul pay senedi piyasasında sürü davranışının ölçülmesi üzerine kurulmuştur. Buradan hareketle oluşturulan temel hipotez aşağıdaki gibidir:

H₀: BIST pay senedi piyasasında piyasa yönünde sürü davranışı yoktur.

H₁: BIST pay senedi piyasasında piyasa yönünde sürü davranışı vardır.

Hipotezlerin test edilebilmesi için Christie ve Huang (1995) tarafından geliştirilen pay senedi getiri oranlarının yatay kesit değişkenliklerinin incelenmesine dayanan yatay kesit standart sapma (Cross-Sectional Standart Deviation-CSSD) yöntemi kullanılmıştır. Bu yöntemde pay senedi getiri oranlarının yatay kesit değişkenliği ile kukla değişkenler kullanılarak elde edilen en yüksek ve en düşük piyasa getiri oranları arasında regresyon ilişkisi kurulmaktadır¹. Bu şekilde kurulan regresyon modeli aşağıdaki gibidir (Kayalıdere, 2012: 82-83; Doğukanlı ve Ergün, 2011: 238; Altay, 2008: 38-39);

$$CSSD_t = \alpha + \beta^D D_t^D + \beta^Y D_t^Y + \varepsilon_t \quad (1)$$

Modelde CSSD_t, t gününde pay senedi getiri oranlarının piyasa getiri oranından yatay kesit standart sapmasını göstermektedir. Diğer bir ifadeyle her bir pay senedinin t günündeki yatay kesit standart sapmalarının toplamını ifade etmektedir. Modeldeki bağımlı değişken olan ve yatay kesit standart sapmayı ölçen CSSD_t'nin matematiksel ifadesi aşağıdaki gibidir;

$$CSSD_t = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^N (R_{it} - R_{mt})^2}{N-1}} \quad (2)$$

Burada R_{it}, i pay senedinin t günündeki getiri oranını; R_{mt}, t gününde pazar portföyünün (piyasanın) getiri oranını; N ise pay senedi sayısını göstermektedir.

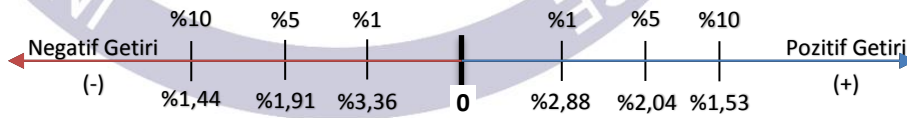
Modelin açıklayıcı kısmında yer alan $\beta^D D_t^D$ değişkeni, piyasanın alt uç değerlerinde (düşme eğiliminde) bulunması durumunda "1", bulunmaması durumunda "0" değerini alan kukla değişkeni, $\beta^Y D_t^Y$ değişkeni ise piyasanın üst uç değerlerinde bulunması durumunda "1", bulunmaması durumunda "0" değerini alan kukla değişkeni ifade etmektedir. Böylece modelde piyasa getirilerinde aşırı oynaklığın

¹ Buradaki model, yatay kesit standart sapma ile endeks (piyasa) getirisi arasındaki ilişkinin doğrusal olduğu varsayımına dayanmaktadır (Prosad, Kapoor ve Sengupta, 2012: 13).

yaşandığı (yükseliş ve düşüş) dönemler de temsil edilmiş olmaktadır². Modelden elde edilecek β^D ve β^Y katsayılarının anlamlı ve negatif olması piyasa yönünde sürü davranışı olduğunun göstergesi olarak sayılmaktadır. Çünkü oynaklığın yüksek olduğu dönemlerde pay senedi getiri oranları pazara ait getiri etrafında toplanmakta ve pay senetlerinin yatay kesit değişkenliği azalmaktadır. Dolayısıyla yatırımcının en az piyasa kadar getiri elde etmek için piyasayı taklit ederek yatırım kararları vermesiyle elde edeceği getiri oranları piyasa portföyünün getiri oranlarına yaklaşacak diğer bir ifadeyle bu getiri oranlarının etrafında toplanacağından yatay kesit standart sapma değişimi azalacaktır.

Çalışmada analiz edilecek periyod olarak 4 Ocak 2016 ile 24 Ekim 2018 dönemi belirlenmiştir. Borsa İstanbul'da yer alan BİST-30 endeksindeki 30 firmanın günlük getiri oranları kullanılmış ve 708 gözlem elde edilmiştir³. Yöntem yatay kesit değişkenliğine dayandığı için kıyaslama ölçütü olarak BİST-100 endeksi piyasa getirisi olarak dikkate alınmıştır. Endekse ait getiri oranları da günlük olarak dikkate alınmıştır. Çalışmaya ait veriler investing.com sitesinden temin edilmiştir. Çalışmada yer alan pay senetleri sayısında BİST-30 ve BİST-100 dikkate alındığı için gün bazında bir değişiklik yapılmamıştır.

Modelde kukla değişken atanayan piyasanın aşırı yükseldiği ve düştüğü günler, BİST-100 endeksinin getiri oranlarının sıklık dağılımı içinde pozitif ve negatif olarak %1'lik, %5'lik ve %10'luk uç bölgeye denk düşen getiri oranlarının gerçekleştiği günler olarak dikkate alınmıştır. Dolayısıyla piyasa yükselirken uç getiri dilimlerine denk gelen günler piyasada stresin yaşandığı günler olarak kabul edilmiştir. Ters durumda da piyasa düşerken uç getiri dilimlerine denk gelen günler piyasada stresin yaşandığı günler olarak dikkate alınmıştır. Çalışmada BİST-100 endeksinin getiri oranlarının dağılımı incelenmiş ve hem yükseliş hem de düşüş dönemlerine ilişkin %'lik uç değerler aşağıdaki gibi belirlenmiştir (Şekil-1).



Şekil-1: %'lik Uç Değer Dağılımları

Buna göre analiz periyodu boyunca Bist-100'de yaşanan ekstrem/aşırı uçtaki piyasa getirilerinin olduğu günler örneklemin %1, %5 ve %10'u şeklinde kukla değişken atanarak belirlenmiştir⁴. Analizlerde SPSS 22 paket programı kullanılmıştır.

3. BULGULAR VE TARTIŞMA

² ϵ_t hata terimini gösterir.

³ Analiz kapsamındaki şirketlerin listesi Ek-1'de gösterilmiştir.

⁴ Christie ve Huang (1995) çalışmalarında bu değerleri genellikle %1 ve %5'lik dilimler olarak dikkate almışlarsa da Türkiye gibi gelişmekte olan ekonomiler için bu değerlere ek olarak %10 değerini de almak yerinde olacaktır. Benzeri bir davranış Kayalidere (2012) tarafından Prosad, Kapoor ve Sengupta (2012) tarafından da uygulanmıştır.

Çalışma kapsamında analiz edilen BİST-100 endeksine ait getiri oranları ve hesaplanan CSSD değerlerine ilişkin tanımlayıcı istatistikler Tablo-1'de gösterilmiştir. Buna göre 4 Ocak 2006-24 Ekim 2018 dönemi için piyasanın ortalama getiri oranı % 0,0456'dır. Pazar portföyünün bir göstergesi olarak kullanılan R_{mt} getiri aralığı en düşük %-7,08 iken en yüksek aldığı değer ise %4,15'dir. Pazar portföyü veri setinde veriler sola çarpıktır ve bu durumda ortalamalar medyan değerlerinden küçüktür. Basıklık değerinin pozitif olması pazar portföyü verilerinin normalden daha dik bir dağılıma sahip olduğunu işaret etmektedir. CSSD'nin ortalama değeri 0,012638 olarak gerçekleşmiştir. CSSD'nin aldığı değerler minimum 0,0047 maksimum 0,0516 aralığında gerçekleşmiştir. Pozitif çarpıklık değerine sahip olan CSSD'nin verilerinin sağa yatık olduğunu, dağılımda küçük değerlerin fazlalıkta olduğunu ve ayrıca ortalama değer medyandan büyük olduğunu göstermektedir. Her iki veri setine ilişkin dağılımlar Ek-2'de verilmiştir. Her iki veri setine ait JB değerine bakıldığında dağılımların normal dağılmadığı görülmektedir.

| Tablo-1: Tanımlayıcı İstatistikler | | | | | | | | |
|------------------------------------|--------|---------|---------|----------|-----------|-----------|----------|------------------|
| | Gözlem | Minimum | Maximum | Ortalama | Std.Sapma | Çarpıklık | Basıklık | JB |
| BİST-100 (R_{mt}) | 708 | -7,08% | 4,15% | 0,0456% | 1,23835% | -,459 | 2,228 | 169,7282 (0,000) |
| CSSD _t | | ,0047 | ,0516 | ,012638 | ,0043949 | 2,291 | 11,978 | 4783,460 (0,000) |

*JB, Jarque-Bera testini ifade etmektedir. Parantez içindeki değerler p değerini göstermektedir.

Analiz dönemi için en yüksek günlük getiri oranına sahip ilk üç pay senedi; %20 ile Şekerbank, 19,77 ile Kozaanadolu ve %19,54 ile Doğan Holding'tir. En düşük günlük getiri oranına sahip ilk üç pay senedi ise -%35,41 ile Yapıkredi Bankası, -%20 ile Kozaanadolu ve -%19,97 ile yine Kozaanadolu'ya aittir. BİST'te en yüksek getiri oranlarının yaşandığı ilk üç gün; birinci gün 19.12.2017 (%4,15 ile) ikinci gün 25.07.2018 (%3,51 ile) ve üçüncü gün ise 24.05.2016 (%3,48 ile)'dir. Buna karşın BİST'te en düşük getiri oranlarının yaşandığı ilk üç gün ise; birinci gün 18.07.2016 (-%7,08 ile) ikinci gün 11.07.2018 (-%5,18 ile) ve üçüncü gün ise 21.07.2016 (-%4,42 ile)'dir.

BİST-100 endeksinin getiri oranlarının sıklık dağılımı içinde pozitif ve negatif olarak %1'lik, %5'lik ve %10'luk uç bölgeye denk gelen getiri oranlarının gerçekleştiği günler olarak dikkate alındığından dolayı analiz aşamasında 3 model test edilmiştir. Bu kapsamda kurgulanan modeller aşağıdaki gibidir;

$$CSSD_{t_{\%1}} = \alpha + \beta^D D_{t_{\%1}}^D + \beta^Y D_{t_{\%1}}^Y + \varepsilon_t \quad (3)$$

$$CSSD_{t_{\%5}} = \alpha + \beta^D D_{t_{\%5}}^D + \beta^Y D_{t_{\%5}}^Y + \varepsilon_t \quad (4)$$

$$CSSD_{t_{\%10}} = \alpha + \beta^D D_{t_{\%10}}^D + \beta^Y D_{t_{\%10}}^Y + \varepsilon_t \quad (5)$$

Regresyon sonuçları tahmin edilmeden önce analizde kullanılacak olan değişkenlere ait veri setlerinin durağanlığı, otokorelasyon durumu, çoklu doğrusal bağlantı ve değişen varyans sorunu olup olmadığı sınanmıştır. Durağanlık analizi için ADF birim kök testi uygulanmış ve (test istatistiği -

6,592854; p değeri 0,000) durağan bulunmuştur. Çoklu doğrusal bağlantı problemini test etmek için her bir yüzdellik dilim⁵ için VIF değeri (Varyans Şişirme Faktörü) bulunmuş ve bu değer 1-5 arasında olduğu tespit edilmiştir. Sonuç olarak değişkenler arasında çoklu doğrusal bağlantı problemi olmadığı görülmüştür. Denklem (3) %1'lik dilimlerin dikkate alındığı modelde hatalarda değişen varyans problemi White testi kullanılarak sınanmış ve değişen varyans problemi tespit edilememiştir. Denklem (4) ve Denklem (5) için yapılan testlerde ise değişen varyans problemi gözlemlendiğinden EKK tekniğinin en önemli varsayımlarından biri olan sabit varyans varsayımının sağlanamadığı görülmüştür⁶. Ayrıca her üç modelde de otokorelasyon problemiyle karşılaşıldığından hem otokorelasyon probleminin hem de değişen varyans probleminin düzeltilmesinde Newey-West (1987) prosedürü uygulanmıştır (Ulzii, Moslehpour ve Kien, 2018)⁷. 30 pay senedinin analiz periyodu içinde her bir güne ait yatay kesit standart sapmalarıyla %1, %5 ve %10'luk uç değerleri temsil eden kukla değişkenler arasındaki regresyon analizi sonuçları aşağıda Tablo-2 de verilmiştir.

Tablo-2: Modellere Ait Regresyon Analizi Sonuçları

| PANEL-A: Bağımlı Değişken: CSSD _{t%1} | | | | |
|---|-----------------------------------|-----------|---------------|----------|
| Değişkenler | Katsayı | Std. Hata | t-İstatistiği | p değeri |
| β^D | 0.011729 | 0.0034353 | 3.41 | 0.0001 |
| β^Y | 0.005119 | 0.0007510 | 6.82 | 0.0007 |
| OC | 0.012464 | 0.0001577 | 79.03 | 0.0000 |
| R-kare | 0.084312 F-istatistiği | | | 28.84 |
| Düzeltilmiş R-kare | 0.081715 P değeri (F-istatistiği) | | | 0.000 |
| PANEL-B: Bağımlı Değişken: CSSD _{t%5} | | | | |
| Değişkenler | Katsayı | Std. Hata | t-İstatistiği | p değeri |
| β^D | 0.007948 | 0.0014124 | 5.63 | 0.0000 |
| β^Y | 0.002542 | 0.0005412 | 4.70 | 0.0002 |
| C | 0.012098 | 0.0001449 | 83.48 | 0.0000 |
| R-kare | 0.169359 F-istatistiği | | | 26.16 |
| Düzeltilmiş R-kare | 0.167002 P değeri (F-istatistiği) | | | 0.000 |
| PANEL-C: Bağımlı Değişken: CSSD _{t%10} | | | | |
| Değişkenler | Katsayı | Std. Hata | t-İstatistiği | p değeri |
| β^D | 0.006349 | 0.000971 | 6.54 | 0.0000 |
| β^Y | 0.002731 | 0.0004878 | 5.60 | 0.0000 |
| C | 0.011831 | 0.0001441 | 82.10 | 0.0000 |
| R-kare | 0.179736 F-istatistiği | | | 35.52 |
| Düzeltilmiş R-kare | 0.177409 P değeri (F-istatistiği) | | | 0.000 |

⁵ %1'lik, %5'lik ve %10'luk uç bölgeye denk düşen getiri oranlarının gerçekleştiği günler bazında testler yapılmıştır.

⁶ Eviews programında test edilmiştir.

⁷ Stata programında test edilmiştir.

Tablo-2 Panel-A'da, %1'lik uç değerler dikkate alınarak kukla değişkenlerle (β^D ve β^Y) oluşturulan regresyon sonuçları verilmiştir. F istatistiği (28.84) ve buna ait p değerine (0,000) bakıldığında kurulan model genel olarak anlamlıdır. Modelin açıklama gücü %8,4'dür. %5'lik uç değerleri dikkate alan Panel-B'de ve %10'luk uç değerleri alan Panel-C'de de benzeri sonuçlar elde edilmiştir. Genel olarak bu iki modelde de kukla değişkenlere (β^D ve β^Y) ait katsayılar pozitif ve %5'lik önem düzeyinde anlamlıdır. Panel-B ve Panel-C'deki modellerin açıklayıcılık yüzdeleri Panel-A'daki modele göre daha yüksek ancak birbirlerine yakındır. Her üç modelde de β^D ve β^Y kukla değişkenlere ait katsayıların anlamlı ve pozitif olması %1'lik, %5'lik ve %10'luk getiri dilimlerinde aşırı oynaklığın olduğu günlerde pay senetlerinin yatay kesit standart sapmasının arttığını göstermektedir. Bu sonuç BİST-100 endeks getiri oranları arttıkça yatay kesit standart sapmanın arttığını ifade eder. Söz konusu bu durum sürü davranışının olmadığı kanıtı olarak algılanabilir. Diğer bir ifadeyle bu sonuçlar, inceleme dönemindeki 30 pay senedine ait getiri oranlarının BİST-100 endeksi etrafındaki dağılımı artırdığını göstermektedir. Dolayısıyla incelenen dönemde günlük bazlı işlemlerde yatırımcıların benzer hareket etmedikleri ortaya çıkmıştır.

Elde edilen bulgularda, %5'lik ve %10'luk uç değerler dikkate alındığında β^D ve β^Y katsayılarının birbirine oldukça yakın oldukları görülmektedir. Bu durum piyasanın aşırı düşüş yaşadığı veya aşırı yükseliş yaşadığı günlerde pay senedi getiri oranlarının endeks etrafındaki dağılımının birbirine benzer olduğunu göstermektedir. Diğer bir ifadeyle getiri dağılımlarının piyasanın yükselmesiyle veya düşmesiyle farklılaşmadığını ortaya koymaktadır. Ancak %1'lik uç değerler dikkate alındığında ise β^D 'nin katsayısı β^Y 'nin katsayısından büyük çıkmıştır. Dolayısıyla piyasanın düşüşte olduğu günlerdeki pay senedi getiri oranlarının endeks etrafındaki dağılım artışının piyasanın yükselişte olduğu günlerdeki dağılım artışından daha küçük olduğu sonucu çıkarılabilir. Bu sonuç, yatırımcıların piyasa yükselirken sürü davranışı gösterme eğiliminin piyasanın düşüşte olmasına göre daha yüksek olduğunu işaret etmektedir. Elde edilen bulgular Gleason, Mathur ve Peterson (2004), Altay (2008), Kayalıdere (2012), Ergün ve Doğukanlı (2015), Prosad, Kapoor ve Sengupta (2012) ve Altunöz (2018) çalışmalarının sonuçlarıyla tutarlıyken Ulzii, Moslehpour ve Kien (2018) çalışmalarında elde edilen sonuçlarla uyumsuzdur.

4. SONUÇ VE DEĞERLENDİRME

Borsa İstanbul pay senetleri piyasasında sürü davranışının ölçülmesi amacıyla gerçekleştirilen bu çalışma kapsamında BİST-30 endeksinde işlem gören 30 şirket dikkate alınmıştır. Bu doğrultuda öncelikle her bir şirketin ve kıysalama ölçütü olarak da BİST-100 endeksinin ortalama getirileri hesaplanmıştır. Getiriler dikkate alınarak piyasanın aşırı oynak olduğu günlerde %1, %5 ve %10'luk uç bölgelere denk gelen getiri oranlarının gerçekleştiği günler kukla değişken şeklinde çalışmaya dahil edilmiştir.

Analiz aşamasında üç ayrı model kurulmuş, öncelikle bu modellere ilişkin verilerin durağanlığı, otokorelasyon ve değişen varyans sorunları test edilerek, nihayetinde 30 şirketin her bir güne ait yatay kesit standart sapmalarıyla kukla değişkenler arasındaki ilişki ayrı ayrı regresyon analizleriyle incelenmiştir. Elde edilen bulgulara göre aşırı yükseliş ve düşüş dönemlerindeki kukla değişkenlere ait katsayılar anlamlı ve pozitif çıktığından, diğer bir ifadeyle BİST-100 endeks getiri oranı arttıkça yatay kesit standart sapma da arttığından, BİST-30 endeksinde ilgili dönemde sürü davranışının olmadığı sonucuna ulaşılmıştır.

Bu çalışmada kurulan regresyon modelinin doğrusal olduğu varsayımıyla işlemler yapılmıştır (Christie ve Huang: 1995). Ancak değişkenler arasında doğrusal olmayan bir ilişkinin var olabileceği düşüncesiyle analizler Chang, Cheng ve Khorana (2000) geliştirdiği model kapsamında tekrar yapılabilir. Literatürde benzer çalışmalarda anlamlı ve negatif ilişkiler çıkmıştır. Bu kapsamda gelecekteki çalışmalarda ilgili dönem için doğrusal olmayan bir ilişkinin varlığı ile Chang, Cheng ve Khorana (2000) modeli uygulanabilir. Ayrıca analiz dönemi daha uzun tutularak ve alt periyodlara ayrılarak ekonomik ve politik belirsizliğin olduğu dönemlerde sürü davranışının varlığı sınanabilir.

KAYNAKÇA

- Altay, E. (2008) "Sermaye Piyasasında Sürü Davranışı: İMKB'de Piyasa Yönünde Sürü Davranışının Analizi", BDDK Bankacılık ve Finansal Piyasalar, 2(1), 27-58.
- Altunöz, U. (2018) "Does Herd Behaviour Exist In Turkish Stock Markets? The Case Of Borsa Istanbul", Proceedings of International Academic Conferences. International Institute of Social and Economic Sciences, 2018.
- Bikhchandani, S. ve Shrama, S. (2001) "Herd Behavior in Financial Markets", IMF Staff Papers, 3, 279-310.
- Chang, E. C., Cheng, J. W. ve Khorana, A. (2000) "An Examination of Herd Behavior in Equity Markets: An International Perspective", Journal of Banking and Finance, 24, 1651-1679.
- Chen, Y. (2002) "Domestic Investors' Herding Behavior in Reaction to Foreign Trading", National Taiwan University College of Management, International Conference on Finance, 24-25.
- Christie, W. G. ve Huang, R. D. (1995) "Following the Pied Piper: Do Individual Returns Herd around the Market?". Financial Analysts Journal, 51, 31-37.
- Çoban, A. T. (2009) "İMKB'de Sürü Davranışının Test Edilmesi", Yüksek Lisans Tezi, Çukurova Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Adana.
- Decamps, J. P. ve Lovo, S. (2002) "Risk Aversion and Herd Behavior in Financial Markets", <http://ssrn.com>.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

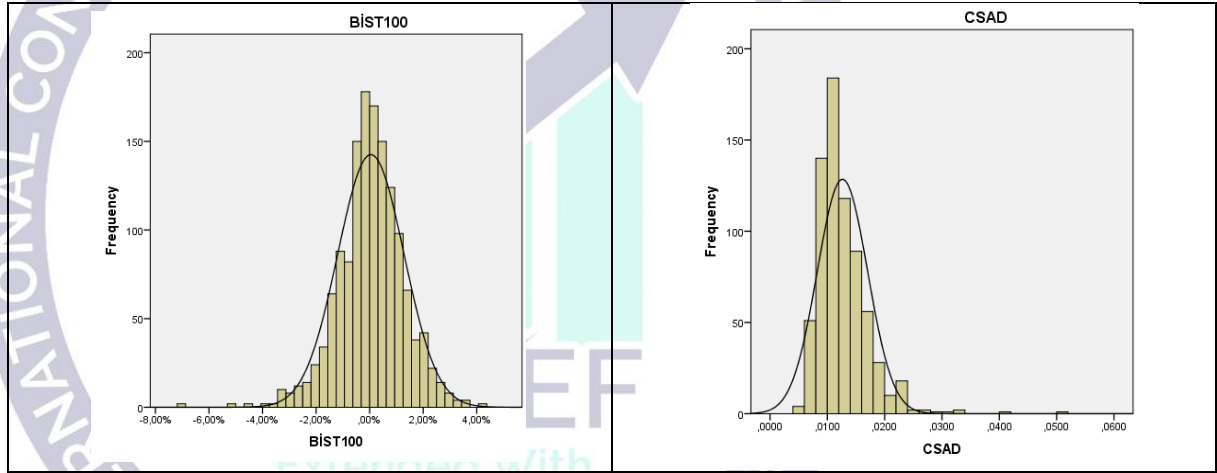
November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Doğukanlı, H. ve Ergün, B. (2011) “İMKB’de Sürü Davranışı: Yatay Kesit Değişkenlik Temelinde Bir Araştırma”, İşletme Fakültesi Dergisi, 12(2), 227-242.
- Doğukanlı, H. ve Ergün, B. (2015) “Bist’te Sürü Davranışı: Hwang ve Salmon Yöntemi ile Bir Araştırma”, Finans Politik & Ekonomik Yorumlar, 52(603), 7-24.
- Gleason, K. C., Mathur, I. ve Peterson, M. A. (2004) “Analysis of intraday herding behavior among the sector ETFs”, *Journal of Empirical Finance*, 11, 681-694.
- Hwang, S. ve Salmon, M. (2004) “Market Stress and Herding”, *Journal of Empirical Finance*, 11(4), 585-616.
- Işık, F. G. (2018) “Pay Piyasalarında Sürü Davranışı: Borsa İstanbul Üzerine Bir Uygulama”, Yüksek Lisans Tezi, Mustafa Kemal Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Hatay.
- Kahneman, D. ve Tversky, A. (1979) “Prospect Theory: An Analysis of Decision Under Risk”, *Econometrica*, 47, 263-291.
- Kayalıdere, K. (2012) “Hisse Senedi Piyasasında Sürü Davranışı: İMKB’de Ampirik Bir İnceleme”, İşletme Araştırmaları Dergisi, 4, 77-94.
- Kıyılar, M. ve Akkaya, M. (2016) “Davranışsal Finans”, İstanbul: Literatür Yayıncılık.
- Prosad, J. M., Kapoor, S. ve Sengupta, J. (2012) “An Examination of Herd Behavior: An Empirical Evidence from Indian Equity Market”, *International Journal of Trade, Economics and Finance*, 3(2), 154-157.
- Ulzii, M., Mostehpoor, M. ve Kien, P. V. (2018) “Empirical Models of Herding Behaviour for Assian Countries with Confucian Culture”, *International Conference of the Thailand Econometrics Society*, Springer, Cham, 2018. p. 464-491.

Ek-1: Analiz Kapsamındaki Pay Senetleri

| | | | |
|----------|-------------|-----------|-------------|
| AKBANK | EREGLİ | OTOKAR | TOFAŞ |
| ARÇELİK | GARANTİ | PEGASUS | TÜPRAŞ |
| ASELSAN | SAHOL | PETKIM | TELEKOM |
| BİM | KARDEMİR | ŞEKERBANK | TRCELL |
| DOĞAN | KOÇ | ŞİŞECAM | HALKBANKASI |
| EMLAK | KOZAALTIN | TAV | İŞBANK |
| ENERJİSA | KOZAANADOLU | TEKFEN | VAKIFBANK |
| | | THY | YAPIKREDİ |

Ek-2: CSSD_t ve R_{mt}'ye İlişkin Histogramlar



ÖZET

Yardımların yoksullukla mücadele hedefine ulaşabilmesinde, kullanım amacı ve dağıtım mekanizmasının önemli bir role sahip olduğu kabul edilmekle birlikte kurumsal kalite göstergelerinden biri olan yolsuzluk seviyesinin donör ülkeler açısından önem teşkil edip etmediği sınırlı sayıda çalışmanın konusu olmuştur. Yapılan çalışmalarda kullanılan regresyon analizine bağlı olarak ortalamaya dayalı bir tahmin yapıldığında, uç değerlerin dikkate alınmaması sonucu parametrelerin sapmalı olduğu görülmektedir. Ancak, kantil regresyon analizi, tahminleri ortamaya değil de kantillere dayalı olarak gerçekleştirme olanağı sağladığından verilerdeki uç değerler ve değişen varyans sorunu da dikkate alınmaktadır. Bu bağlamda, çalışmada 2006-2016 döneminde yolsuzluk seviyesinin DAC ve AB üyesi ülkelerin yükselen piyasa ekonomilerine yaptıkları yardımlar üzerindeki etkisi daha etkin sonuçları veren kantil regresyon analizi ile ele alınmaktadır. Bulgular, yolsuzluk ve DAC tarafından verilen yardımlar arasındaki ilişkinin kantiller düzeyinde değiştiğini göstermektedir. Ancak, yolsuzluk ve AB üyesi tarafından verilen yardımlar arasında herhangi bir kantilde istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki elde edilememektedir.

Anahtar kelimeler: Dış yardım, Yolsuzluk, Yönetişim, Kantil regresyon, Panel veri

Jel Kodu: C31, D73, F35

DOES CORRUPTION IMPORTANT FOR FOREIGN AID? QUANTILE REGRESSION ANALYSIS
ABSTRACT

It is accepted that financial aid's purpose of use and distribution mechanism has an important role in reaching the aim of combating poverty, there are also limited studies on whether the level of corruption, which is one of the institutional quality indicators, is important for donor countries. While estimation based on mean in regression analysis which are not taking into account extreme values into account, quantile regression analysis allows estimations to be based on quantiles and the extreme values in the data and the heteroscedasticity will be taken into account. In this study, the impact of the level of corruption on the aid provided by DAC and EU member countries to emerging market economies in the period of 2006-2016 is analysed by quantile regression The findings show that the

* İskenderun Teknik Üniversitesi, İşletme ve Yönetim Bilimleri Fakültesi, Ekonomi Bölümü, Hatay, Türkiye
reyhan.cafri@iste.edu.tr.

** Mardin Artuklu Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, Mardin, Türkiye, pinarozdemircukadar@artuklu.edu.tr.

relationship between corruption and the foreign aid provided by the DAC has changed at the quantile level. However, there is no statistically significant relationship between corruption and aid provided by the EU member.

Key Words: *Foreign Aid, Corruption, Governance, Quantile Regression, Panel Data*

Jel Classification Code: *C31, D73, F35*

1.GİRİŞ

Dış yardımlar, ekonomik gelişmenin itici gücünün sanayileşme olduğunun kabulü ile tasarruf yetersizliği yaşayan ülkeler için bir çıkış yolu olarak görülmüştür. Özellikle İkinci Dünya Savaşı'ndan sonra sistematik hale gelen dış yardımlar, en az %25'i hibe olarak verilen, kamusal yapının iyileştirilmesi, temel sosyal hizmetler, ekonomik ve siyasi kurumların güçlendirilmesi gibi amaçlara hizmet eden ödemelerdir (Üçkuş ve Kendirici, 2012). Resmi ve gayri resmi, iki taraflı ve çok taraflı tüm hibe ve yükümlülükler de yardımlar grubuna girmektedir (Khan ve Hoshino, 1992).

Yardımların yoksullukla mücadele hedefine ulaşabilmesinde kullanım amacı ve dağıtım mekanizmasının önemli bir role sahip olduğu düşüncesinin yanı sıra (Mahembe ve Odhiambo, 2017; Collier ve Dollar, 2002; Tavares, 2003; Okadaa ve Samreth, 2012; Asongu ve Jellal, 2013), kurumsal kalite düzeyinin yardımların gelir dağılımını iyileştirmesi ve ekonomik büyüme üzerinde herhangi bir etkisinin olmadığını savunan araştırma bulguları da mevcuttur (Chong, Gradstein ve Calderon, 2009).Yardım veren ülkelerin, yardım verdikleri ülkelerin siyasi sistemleri, nüfusları ve gelir düzeylerini dikkate aldığı, yardımın düzeyinin bütçe açıkları, ekonomik gelir seviyesi ve finansal istikrar gibi unsurlar yardımın düzeyi için belirleyici olduğu da savunulmaktadır (Dang, Knack ve Halsey, 2013). Fakat yardımları veren ve yardımları alan ülkeler arasındaki ilişkiler incelendiğinde, yardımların çoğunlukla siyasi ve stratejik nedenlerle yapıldığı sonucuna ulaşan çalışmalarında mevcut olduğu görülmektedir. Stratejik nedenlerle yapılan yardımlarda, yardım yapılan ülkelere kendi taraftarlarına kaynak aktaran patronajlık sistemlerinin desteklendiği ve kurumların güçlendirilmesi gibi bir kaygının güdümediği sonucuna ulaşılmaktadır. Zira Afrika ülkelerine yapılan yardımlarda bu özellik açıkça izlenmektedir (Gibson, Hoffman ve Jablonski, 2015).

Bu çalışmanın amacı dış yardımlar ve yolsuzluklar arasındaki ilişkiyi kantil regresyon yoluyla uygulamalı olarak irdelemektir. Literatürde sınırlı ve çelişkili sonuçların bulunduğu yolsuzluğun dış yardım akışı üzerindeki etkisinin daha etkin sonuçları veren kantil regresyon analizi ile ele alınması çalışmanın amacını oluşturmakta ve literatüre önemli bir katkı sağlayacağı düşünülmektedir. Çalışmanın izleyen ikinci bölümünde literatür sunulacak, üçüncü ve dördüncü bölümlerde yöntem ve veri seti tanıtılacaktır. Çalışmanın beşinci bölümünde uygulama bulgularının sonuçları sunulacaktır. Sonuç

bölümünde uygulamadan elde edilen bulgular literatürden elde edilen sonuçlar kıyaslanarak genel bir değerlendirme yapılacaktır.

2.LİTERATÜR TARAMASI

Dış yardımlar ile yolsuzluk arasındaki ilişkiyi inceleyen çalışmalarda genellikle dış yardımların yolsuzluk üzerindeki etkisine ağırlık verildiği gözlenmektedir. Bunlardan biri olan Knack (2001), çalışmasında yardım bağımlılığının kurumsal kaliteyi, hesap verebilirliği zayıflatabileceğini; rant arayışı ve yolsuzluğu teşvik edebileceğini ileri sürmüştür ve bu iddiayı test etmek adına gelişmekte olan ülkelerin 1995 yılı verilerini kullanarak yatay kesit analizi gerçekleştirmiştir. Yüksek yardım düzeylerinin bürokratik kalite, yolsuzluk ve hukukun üstünlüğü ile ölçülen kurumların kalitesini olumsuz yönde etkilediği sonucunu elde etmişlerdir. Alesina ve Weder (2002), yine yardımların yolsuzluk düzeyini nasıl etkilediğini 1981 ve 1995 yılları arasında 63 ülke grubu için ele almışlar ve yardımın yolsuzluğun azalması ile ilişkili olmadığı tam tesine yardımların yolsuzlukları arttırdığı sonucuna ulaşmışlardır. Tavares (2003), ülke yöneticilerinin dış yardımlarlar vasıtasıyla piyasa fiyatının altında üretim ve finansman sağladığını ve taraftarlarına kolaylıkla kaynak aktarabildiklerini vurgulamaktadır. Dış yardımlar ve yolsuzluklar arasındaki ilişkiyi araç değişken kullanarak panel veri analizi yöntemiyle analiz eden Tavares (2003), dış yardımların yolsuzluğu azalttığı sonucuna ulaşmıştır. Bu sonucun ortaya çıkmasının temel nedenleri olarak dış yardımları veren ülkelerin ihtiyari politikalara ve keyfiliğe sınır koyması yani "şartlılık" ve yardımların kamu görevlilerine ödenen maaşları arttırması yani "likidite" etkisi olarak görülmektedir. Bräutigam ve Knack (2004), bürokratik kalite, hukukun üstünlüğü ve yolsuzluğa odaklanarak iyi yönetişimin yardımlar üzerindeki etkisini Sahra altı Afrika ülkeleri için analiz etmişler ve yüksek yardım seviyeleri ile yönetişimde bozulmalar arasında güçlü bir istatistiksel ilişki olduğu sonucuna ulaşmışlardır. Knack (2004), 1975-2000 yılları arasında geniş bir örneklem grubu üzerinde yaptığı çok değişkenli analizde, demokratikleşme de halkın şeffaflık taleplerinin önemli bir yeri olduğunu vurgulayarak demokratikleşme ve dış yardımlar arasındaki ilişkiyi incelemiş ve anlamlı bir sonuca ulaşamamıştır. Rajan ve Subramanian (2007), 1981-2000 yılları için panel veri analizi kullandığı çalışmasında dış yardımların imalat sanayisi aracılığı ile ekonomik büyümeye sunduğu katkı ve yönetişim göstergelerinin imalat sanayi üzerindeki etkisini tartışmaktadır. Çalışmada, imalat sanayinde yapılan birçok işlem objektif kriterleri baz alması gerektiğinden iyi yönetişimin imalat sanayi ve dolayısıyla büyüme üzerinde önemli etkisi olacağı savunulmaktadır. Buna göre çalışmada yapılan uygulama da, dış yardımların ülkenin sanayileşme düzeyi ile ilişkili olduğu, sanayileşme oranı ne kadar düşükse dış yardımların o kadar yüksek olduğu sonucuna varılmıştır. Dalgaard ve Olsson (2008), düşük yardım seviyeleri için yardımın yolsuzluğu azaltmada başarılı olabileceğine ancak yüksek yardım seviyelerinde olamayacağına, yani yardımın yolsuzluk üzerindeki etkisinin doğrusal bir yapı sergilemediğine dikkat çekmişlerdir ve analiz sonucunda doğrusal olmayan yapı desteklenerek yardımların düşük yardım seviyelerinde yolsuzluğu azalttığını, ancak yüksek yardım

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

seviyelerinde yolsuzluğu arttırdığını bulmuşlar. Askarov & Doucouliagos (2015) da çalışmasında yardımların, demokrasi ve yönetim kalitesi üzerindeki etkisini 32 geçiş ekonomisi ülke için 1990-2012 yıllarını kapsayacak şekilde doğrusal olmayan yapıyı dikkate alarak panel veri analizi ile incelemişlerdir. Finansal yardımların demokrasiyi arttırdığı ancak yolsuzluk, hukukun üstünlüğü gibi iyi yönetim kalitesi göstergeleri üzerinde etkisi olmadığı sonucuna ulaşmışlardır. 1995'ten 2009'a kadar olan verilere dayanarak, Okada ve Samreth (2012), hem basit bir EKK regresyonu hem de farklı kantillerle yardımın yolsuzluğa etkilerini analiz etmelerini sağlayan bir kantil regresyon yaklaşımı kullanmışlardır. Yardımın çok taraflı kurumlar tarafından ve halihazırda yolsuzluk düzeylerini kontrol etmek için alıcı ülkelere tahsis edildiğinde, yolsuzlukla mücadelede yardımcı olma eğiliminde olduğu bulunmuştur. 1970-2010 yılları arasında 116 ülkeden oluşan bir panel kullanarak, dış yardım akışlarının çeşitli kurumsal kalite ölçümlerine olan etkilerini tahmin eden Young & Sheehan (2014), yardım akışlarının siyasi ve ekonomik kurumları olumsuz yönde etkilediğini tespit etmiş ve yardım alan bir hükümetin vergi gelirlerinin toplanmasına daha az bağımlı olduğunu bu nedenle de vatandaşlarına daha az duyarlı, hesap verebilir olabileceğini ve yolsuzluk etkisi yaratabileceğini vurgulamışlardır. Büyük bir örneklem grubu için yardım akışlarının iyi yönetim kalitesinin bir göstergesi olan yolsuzluk, yasa/düzen ve bürokrasi kalitesi üzerine etkisini araç değişkenler yöntemi ile inceleyen Busse & Gröning (2009) yardımın yönetim üzerinde olumlu bir etkiye sahip olmaktan ziyade negatif bir etkiye sahip olduğunu ve sonucun çeşitli modeller için sağlam (robust) olduğunu vurgulamışlardır. Asangu (2012), 1996-2010 yılları arasında Afrika ülkelerinde dış yardımların yolsuzluk üzerindeki etkisini iki aşamalı EKK ve dinamik panel veri analizi ile irdelemiş ve değişkenler arasında pozitif yönlü anlamlı ilişki bulmuştur. Asangu ve Jellal (2013), 1996-2010 yılları arasında Afrika ülkeleri üzerinde yaptıkları çalışmalarında iki aşamalı EKK ve araç değişken kullanarak kamu sektörünün yatırım kanalları ve yolsuzluk arasındaki ilişkiyi incelemişlerdir. Çalışmadan elde edilen bulgulara göre kamu sektörü aracılığı ile yapılan harcamalarda yolsuzluklar artarken kalkınma yardımlarının özel sektörü desteklemesi ve vergilerin azalması yolsuzlukları azaltmaktadır. 2000-2012 döneminde, Çin yardım projelerinin Afrika'da yerel düzeydeki yolsuzluğu tetikleyip tetiklemediğini araştıran Isaksson ve Kotsadam (2018) ise, ampirik sonuçlarda Çin proje sahaları etrafında daha yaygın bir yolsuzluğa işaret edildiğini göstermişlerdir. Ayrıca Çin'in geliştirmekte olan ülkelerin liderleri ile ittifaklar kurmak, kendi iç şirketleri için ticari avantajlar sağlamak ve doğal kaynak olanaklarına erişmek için yozlaşmış ve demokratik olmayan rejimleri desteklemek için kalkınma finansmanlarını kullandıklarını vurgulamışlardır.

Literatürde yolsuzluk algısının donör ülkeler için nasıl bir etki yarattığını inceleyen çalışmalar oldukça sınırlı sayıdadır. Bunlardan biri olan yolsuzluğun 1990'larda hızla büyüdüğü Mozambik örneğini teorik çerçevede ele alan Hanlon (2004), bağışçıların yolsuzluğa karşı çıkmakta olduğunu, ancak hükümetlerin yolsuzluğa daha fazla yardım etmekte olduğunu vurgulayarak “pazar dostu” politika

değişiklikleri gerçekleştirmesi halinde, bağışçıların oldukça bariz bir yolsuzluğu tolere etmeye hazır olduğunu savunmaktadır. Yardım ve yolsuzluk arasındaki ilişkinin belirleyicilerine odaklanan Isopi ve Mattesini (2010), yolsuzlukların yardım üzerindeki etkisine yoğunlaşmışlardır. Çalışmada, 1985-2016 dönemi için OECD Kalkınma Yardım Komitesi (DAC) üyesi olan 168 alıcı ve 14 bağışçıyı dikkate alarak yardım tahsis modeli için Tobit tahmini yapmışlardır. Bağışçıların, alıcı ülkedeki yolsuzluk seviyesini dikkate alıp almadıkları analiz edildiğinde sonuçların bağışçılar arasında geniş farklılıklar gösterdiği ABD, İtalya, Fransa, İspanya ve Kanada gibi ülkelerin yolsuzluk seviyesi yüksek olan ülkelere yardım yaptığı; İngiltere, Avustralya ve Hollanda' da yolsuzluk seviyesinin yardımda önemli olmadığı ve İskandinav ülkeleri, Almanya ve Japonya'da ise yolsuzluğun yardımı olumsuz yönde etkilediği bulgusu elde edilmiştir. Bütthe vd. (2012), dış yardımın düşük yolsuzluk seviyesine sahip olan ülkelerdeki büyümeyi desteklemesi gerektiğini varsayarak bağışçıların yardım alan ülkelerdeki yönetim kalitesine gerçekten önem verip vermediklerini araştırmışlardır. Devlet yardımı (kamu yardımı) ya da STK'lar (özel yardım) tarafından sağlanan ABD yardımlarına odaklanarak, yolsuzluğun yardım üzerindeki etkisinin istatistiksel olarak anlamlı olmadığını tespit etmişlerdir. Yardım alan ülkelerdeki yolsuzluğun, donör ülkeler için dış yardım desteğini azaltıp azaltmadığını 27 AB ülkesi için 2009 Eurobarometre anketi kullanılarak inceleyen Bauhr, vd. (2013) ise, gelişmekte olan ülkelerdeki yolsuzluğa ilişkin algıların, bağış yapan ülkelerin yardım desteğini azaltmasına neden olduğu bulgusunu elde etmişlerdir. Çalışmada ayrıca, yolsuzluğun yardımın etkinliğine dışsal bir engel olarak algılandığı, bu nedenle de donör ülkelerde yardım yorgunluğuna sebebiyet verebileceği vurgulanmaktadır. Bauhr ve Charron (2018), 28 AB üyesi ülke üzerinde yaptığı anket çalışmasında AB üyesi olan borçlu ülkelere yardım yapılması konusunda büyük bir görüş birliği olsada bu yardımların desteklenmesinde ülkeler arasında makroekonomik, politik ve kurumsal ve ülkeye özgü özelliklerin belirleyici olduğu görülmektedir.

Hem yolsuzluğun yardım hem de yardımların yolsuzluk üzerindeki etkisini 1996-2009 döneminde 71 gelişmekte olan ülke için dinamik panel çerçevesinde Granger-nedensellik testleri ile ele alan Menard & Weill (2016) ise bulgular sonucunda yardımların yolsuzluğu etkilemediği, yolsuzluk seviyesinin de bağış yapan ülkelerin yardım tahsis etme teşviklerini değiştirmedeği bulgusuna ulaşmışlardır.

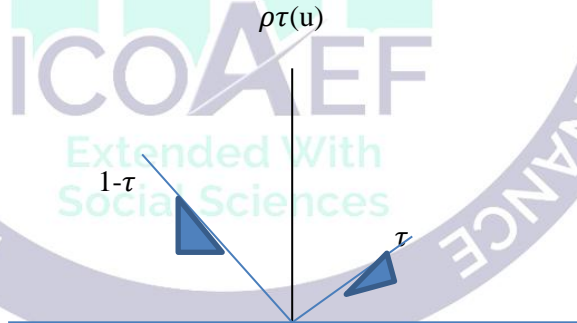
3.YÖNTEM

Klasik en küçük kareler yönteminin uç değerlerden etkilenmesi ve Gausyan olmayan durumlarda sapmalı sonuçlar vermeye meyilli olması yeni arayışların doğmasına neden olmuştur. Bu nedenle Koenker ve Basett (1978) doğrusal modeller için en küçük kareler tahmin edicisinden daha güçlü sonuçlar verecek bir alternatif önermiştir.

Kantil regresyon, koşullu kantil fonksiyonundan çıkarım ve tahmin yapmayı amaçlayan bir istatistiksel yöntemdir. Klasik doğrusal regresyon modeli, koşullu ortalama fonksiyonundan hareketle kalıntı karelerini minimize etmeyi hedeflerken, kantil regresyon medyan fonksiyondan ve diğer kantil fonksiyonlarının tamamından hareket etmektedir. Koşullu ortalama fonksiyonunun tahminlerinin koşullu kantil fonksiyonları ailesinin tamamı ile desteklenmesi ile kantil regresyon rassal değişkenler arasındaki stokastik ilişkiyi daha doğru olarak tespit etme imkanı sunmaktadır. Kantil regresyonun iktisatta kullanım alanı özellikle ücretlerin belirleyiciliği, ayrımcılık etkileri ve gelir eşitsizliği konularıdır. Son dönemlerde herhangi bir topluluğun okul öğrencileri gibi, sosyoekonomik karakteristiğini de ortaya koymakta kullanılmaktadır (Koenker, 2000:1)

Bir topluluk çeyreklik, beşte bir veya onda bir eşit parçaya bölünebilir. Reel sayı olan rassal değişken Y , dağılım fonksiyonu ile gösterilebilir. $F(y) = \text{prop}(Y \leq y)$ iken tüm $0 < \tau < 1$ durumunda $Q(\tau) = \inf\{y: F(y) > \tau\}$ X 'in τ . kantili olarak adlandırılır. Medyan $Q(1/2)$ burada merkezi rol oynamaktadır. Dağılım fonksiyonu gibi, kantil fonksiyonu da rassal değişken Y 'nin tüm özelliklerini gösterebilir. Bu durumda kantiller basit bir optimizasyon problemi olarak ifade edilebilir. Tüm $0 < \tau < 1$ durumunda parçalı doğrusal kontrol fonksiyonu $\rho(\tau) = u(T - I(u < 0))$ şeklinde gösterildiği gibidir (Koenker, 2000).

Şekil 1. Kantil Regresyon ρ fonksiyonu



Kaynak: Koenker, 2000:2

$\rho_\tau(Y - \xi)$ minimize etmek için için en küçük $\xi(\tau)$ için çözüm yapılır. $y_1, y_2 \dots y_n$ bağlı olarak Y 'nin τ . örneklem kantili denklem 1 çözülerek bulunabilir.

$$\min_{\xi \in R} \sum_{i=0}^n \rho_\tau(Y - \xi) \quad (1)$$

Bu durumda doğrusal koşullu kantil fonksiyonu $Q_Y(\tau | X = x) = x_i' \beta(\tau)$

çözülerek $\beta(\tau)$ elde edilebilir. Bu durumda denklem 2, $\beta(\tau)$ elde edilme yöntemini göstermektedir.

$$\hat{\beta}(\tau) = \underset{\beta \in R^p}{\text{argmin}} \sum \rho_\tau(y_i - x_i' \beta) \quad (2)$$

Eğer kullanılan tahminci, medyan koşullu tahminci ise optimal tahminci, $\hat{\beta}$ değerini minimize eden değer olarak kabul edilmektedir. Bu durumda elde edilen hata terimi karesi ile kesin hata kayıp fonksiyonu (absolute error loss function) simetrik ise tahmin hatasının işareti anlamlı olmayacaktır. Eğer koşullu medyan fonksiyonuna göre kantil q , 0.5'den farklı ise artan asimetri etkisinden bahsedilmektedir, bu durumda kantil 0 ile 1 arasında bir değere yakınsamaktadır (Baum, 2013).

Yoo ve Moyeed (2001), kantil regresyonu Bayezyan yaklaşımla geliştirmişlerdir. Zira genelleştirilmiş doğrusal ve toplamsal modellerde Bayezyan öngörü yöntemlerine de sıkça başvurulmaktadır. Sonsal dağılımların belirlenmesi ve daha karmaşık yapıların incelenmesinde Monte Carlo Markov zincirinin (MCMC) kullanılması Bayezyan yöntemleri işlevsel hale getirmektedir. Bu durumda; $y=(y_1, y_2, \dots, y_n)$ veri gözlemler, β 'nin sonsal dağılımı

$$\pi(\beta|y), \pi(\beta|y) \propto L(y|\beta) p(\beta) \quad (3)$$

olarak düzenlendiğinde $p(\beta)$, β 'nin ilk dağılımı, $L(y|\beta)$ maksimum olabilirlik fonksiyonu olmak üzere, fonksiyon denklem 3'deki gibi yeniden düzenlenmektedir:

$$L(y|\beta) = p^n (1-p)^n \exp\{-\sum_i p_p(y_i - x_i \beta)\} \quad (4)$$

Teorik olarak, her önseli (3)'deki gibi kullanmak mümkün olabilir fakat gerçek bilginin olmadığı durumda β 'nin tüm bileşenleri için belirsiz önsel dağılım kullanılması da söz konusu olabilir. Bu tercih, birleşik sonsal dağılımın (joint posterior distribution) olabilirlik düzeyine (likelihood surface) oranı ile sonuçlanmaktadır.

Bu durumda eğer denklem 4'deki gibi bir olabilirlik fonksiyonu ve $p(\beta) \propto 1$ ise β 'nin sonsal dağılımı, $\pi(\beta|y)$, gerçek dağılıma (proper distribution) sahip olacaktır. Bu durumda;

$$0 < \int \pi(\beta|y) d\beta < \infty \quad (5)$$

veya, eşdeğer bir şekilde

$$0 < \int L(y|\beta) p(\beta) d\beta < \infty \quad (6)$$

olmaktadır.

Kantil regresyonun panel verilerde kullanımı son dönemlerde literatürde daha çok yer bulmaya başlamıştır (Aldieri ve Vinci, 2017). Bu kapsamda yapılan çalışmalarda çoğunlukla toplamsal sabit etkili modellerde parametrelerin yorumunu, hata terimini farklı parçalara ayırarak ve hata teriminin zamana bağlı bileşenle ilişkili olduğu varsayımı altında kullanılmaktadır. Fakat Povell (2016), kantil regresyon için grup içi etkileri tanımsal amaçla kullanan ve ayrıştırılmayan hata terimi özelliğini koruyan bir tahminci önermiştir. Bu modelin ve tahmincinin geliştirilmesinde araç değişken yaklaşımına başvurulmaktadır. Tahminler, ancak $T > 2$ durumunda tutarlı sonuç vermekte ve uygulamaya uygun

olarak kabul edilmektedir. Bu durumda d işlem (treatment variable), Y bağımlı değişkenler olmak, τ (τ) kantili göstermek üzere yapısal kantil fonksiyonu toplamsal sabit etkili kantil modellerde

$$S_Y(\tau | d, \alpha_i) = \alpha_i + d' \tilde{\beta}(\tilde{\tau})_i \quad (7)$$

formunu almaktadır.

4. VERİ

Çalışmada 2006-2016 dönemini kapsayan 18 yükselen piyasa ekonomisine ait veri seti kullanılmıştır. Bu ülkeler; Arjantin, Bangladeş, Brezilya, Çin, Endonezya, Filipinler, Güney Afrika, Hindistan, Kolombiya, Malezya, Meksika, Pakistan, Peru, Şili, Tayland, Ukrayna, Türkiye, Venezuela'dır. Bu yükselen piyasa ekonomisi ülkelere yardım veren DAC (kalkınma yardımları komitesi) ve AB üye ülkeleri dikkate alınmaktadır. Veri setinin elde edildiği kaynaklar Ekonomik Kalkınma ve İşbirliği Örgütü (Organization of Economic Cooperation and Development -OECD) ve Dünya Bankası Gelişme Göstergeleri (World Bank Development Indicators-WDI)'dir. Kullanılan veriler hakkında genel açıklamalar ve tanımsal istatistikler Tablo 1'de sunulmuştur. DAC ülkeleri tarafından verilen yardımların minimum değeri -648.48 milyon dolar ile 2008 yılında Tayland'a ait iken maksimum değer 2471.27 milyon dolar ile 2011 yılında Pakistan'a ait olduğu belirlenmektedir. AB ülkeleri tarafından verilen yardımlarda ise minimum değer (-42.88) ile Arjantin'e, maksimum değer (3524.97) ise 2016 yılında Türkiye'ye ait olduğu gözlenmektedir. Yolsuzluk değişkeni dikkate alındığında en az yolsuzluk seviyesinin (17) 2015 yılında Venezuela'ya, en yüksek yolsuzluk seviyesinin (73) 2014 yılında Şili'ye ait olduğu görülmektedir. Değişkenlerin minimum ve maksimum değerleri arasındaki farkın oldukça fazla olduğu dikkat çekmektedir. Dolayısıyla yöntemsel olarak verilerin ortalama değerinden hareket ederek regresyon sonuçlarını yorumlamak sapmalı sonuçlara sebebiyet vermektedir.

Tablo1. Veri Setinin Genel Özellikleri

| Veri | Veri Tanımı | Kaynak | Ortalama | Minimum | Maksimum | Standart Sapma |
|--------------------|---|--------|----------|----------|----------|----------------|
| Yardım(DAC) | DAC (Kalkınma yardımı komitesi) yardımları | OECD | 513.61 | -648.48 | 2471.27 | 584.58 |
| Yardım(AB) | AB ülke tarafından verilen resmi kalkınma yardımları | OECD | 449.21 | -42.88 | 3524.97 | 547.38 |
| Borç | Kamu borçlarının GSYH'ya oranı (%) | WDI | 2.38e+11 | 2.34e+10 | 1.77e+12 | 2.89e+11 |
| Ticaret | Ülkelerin dış ticaretlerinin toplam üretim içindeki büyüklüğü | WDI | 61.18 | 22.11 | 176.67 | 33.43 |
| Yolsuzluk | Yolsuzluk endeksi | WDI | 36.14 | 17 | 73 | 11.34 |

| | | | | | | |
|------|----------------------------------|-----|------|------|-------|-----|
| GSYH | Kişi başına GSYH'nin logaritması | WDI | 9.29 | 7.72 | 10.15 | .59 |
|------|----------------------------------|-----|------|------|-------|-----|

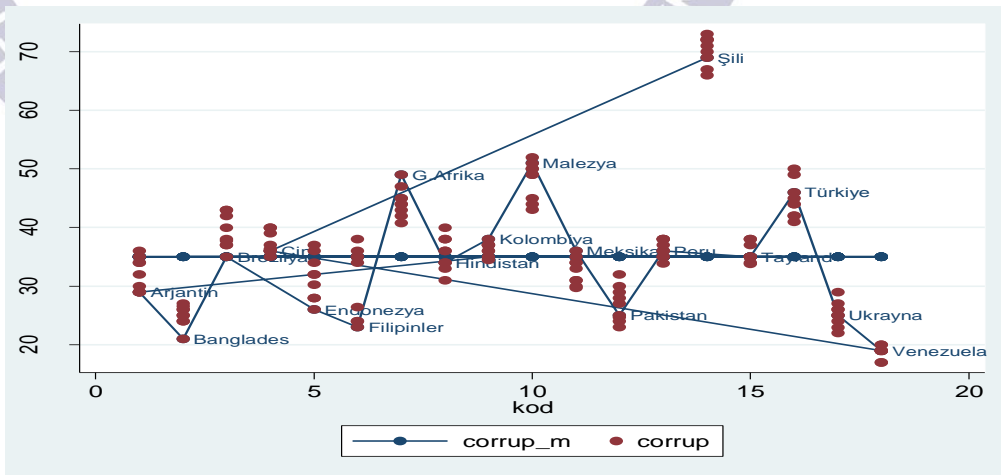
Verilere ait korelasyon matrisi Tablo 2’de sunulmaktadır. Korelasyon matrisine göre DAC üyesi ülkeler tarafından verilen yardımlar ile ticaret, borç,yolsuzluk ve GSYH arasında negatif bir ilişki bulunmaktadır. Ancak yolsuzluk değişkeni için korelasyon katsayısı istatistiksel olarak anlamlı değildir. AB üyesi ülkeler tarafından verilen yardımlar ile ticaret, yolsuzluk ve GSYH arasında negatif istatistiksel anlamlı bir ilişki bulunurken; borç ile pozitif istatistiksel bir ilişki elde edilmektedir. Matriste sunulan değerler çoklu doğrusal bağlantı problemi açısından değerlendirildiğinde bağımsız değişkenler arasında yüksek korelasyon olmadığı görülmektedir.

Tablo2. Değişkenler Arasındaki Korelasyon Matrisi

| | Yardım(DAC) | Yardım(AB) | Ticaret | Borç | Yolsuzluk | GSYH |
|-------------|-------------|------------|-----------|-----------|-----------|-------|
| Yardım(DAC) | 1.000 | | | | | |
| Yardım(AB) | 0.3392*** | 1.000 | | | | |
| Ticaret | -0.3658*** | -0.2512*** | 1.000 | | | |
| Borç | -0.1804** | 0.2588*** | -0.1877** | 1.000 | | |
| Yolsuzluk | -0.0284 | -0.3761*** | -0.0808 | 0.3203*** | 1.000 | |
| GSYH | -0.4983*** | 0.2147** | 0.0943 | 0.2594*** | 0.4286*** | 1.000 |

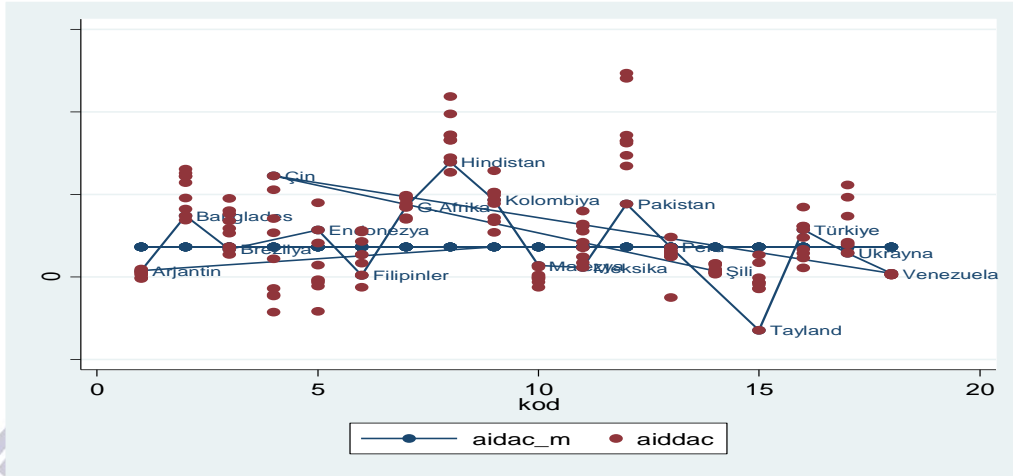
Not: *, **, *** sırası ile %10, %5 ve %1 önem düzeyini temsil etmektedir.

Grafik 1. Ülke Yolsuzluk Endeksi Ortalamalarının Kıyaslanması



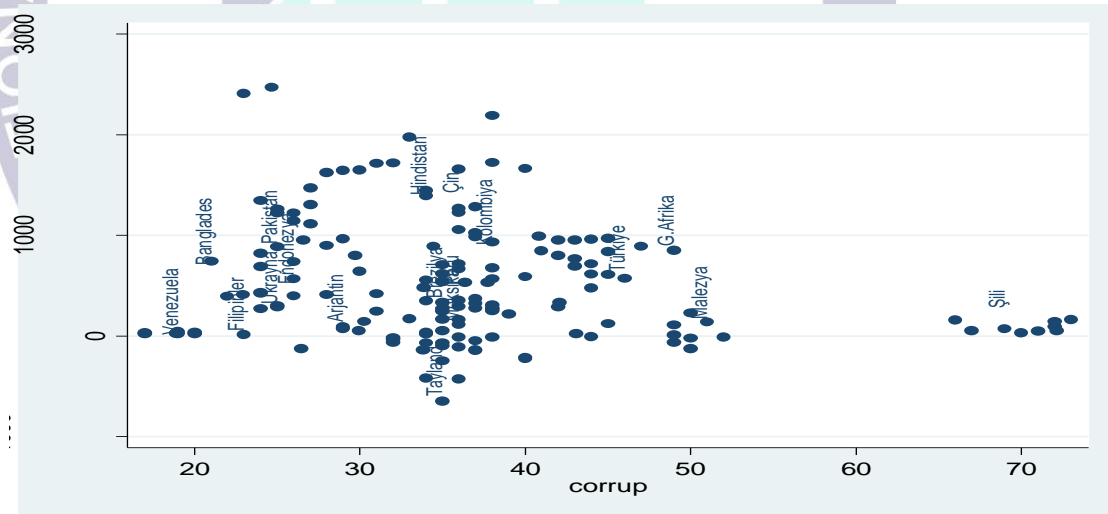
Grafik 1, çalışmaya konu olan 18 yükselen piyasa ekonomisinin ilgili yıllarda yolsuzluk endekslerinin ortalama değerleri arasındaki ilişkiyi göstermektedir. Grafikten izlendiği üzere yolsuzluk endeksi ortalama değerlerine göre Şili en üst sırada yer alan ekonomidir. Güney Amerika ülkeleri, yolsuzluk sıralamalarında çoğunlukla üst sıralarda yer almakla birlikte Venezüela kısmen düşük yolsuzluk ortalamasıyla dikkat çekmektedir.

Grafik2. Resmi Kalkınma Yardımları Ortalamasının Ülkelerarası Kıyaslaması



Grafik 2'ye göre ilgili yıllarda ülkeler arasında resmi kalkınma yardımlarından en çok faydalanan ülkeler Hindistan ve Pakistan'dır, Tayland ise resmi kalkınma yardımlarından en az istifade eden ülke olarak görülmektedir.

Grafik3. Yolsuzluk ve Resmi Kalkınma Yardımları İlişkisi



Grafik 3, korelasyon matrisinde tespit edilen resmi kalkınma yardımları ve yolsuzluk arasında negatif yönlü ilişki ile tutarlı görünmektedir. Buna göre, Şili yüksek yolsuzluğa sahip düşük düzeyli resmi kalkınma yardımı alan ülke görüntüsü çizerken, Hindistan görece olarak daha düşük yolsuzluğa sahip yüksek resmi kalkınma yardımı alan bir ülkedir.

5.AMPİRİK BULGULAR

2006-2016 döneminde 18 yükselen piyasa ekonomisine DAC ve AB üye ülkeleri tarafından verilen resmi kalkınma yardımlarının yolsuzluktan etkilenip etkilenmediğini kantil regresyon analizi ile

araştıran bu çalışmada kantil değerleri en düşük dilimi temsil eden 0.25, medyan değeri ifade eden 0.50 ve üst dilimi ifade eden 0.75 tau değerleri için ele alınmaktadır.

Tablo 3. Yolsuzluğun DAC Tarafından Verilen Yardımlara Etkisi

| | Yardım (DAC) | | | | | |
|------------------|------------------------|---------------------|------------------------|---------------------|------------------------|---------------------|
| | tau= 0.25 | | tau= 0.50 | | tau= 0.75 | |
| | <i>Katsayı</i> | <i>Prob. değeri</i> | <i>Katsayı</i> | <i>Prob. değeri</i> | <i>Katsayı</i> | <i>Prob. değeri</i> |
| Yolsuzluk | 6.2939 (19.4237) | 0.7468 | 21.8548 (17.4655) | 0.2145 | 29.0452** (14.1867) | 0.0439 |
| GSYH | -0.0266 (0.0262) | 0.3135 | -0.0659** (0.0270) | 0.0169 | -0.0701** (0.0294) | 0.0194 |
| Ticaret | 4.8240*** (1.7534) | 0.007 | 1.6167 (1.7283) | 0.3524 | -1.1559 (1.8711) | 0.5385 |
| Borç | 11.2985*** (2.9493) | 0.0003 | 14.7822*** (2.5171) | 0.0000 | 11.0529*** (3.2330) | 0.0010 |

*Not: *, **, *** sırası ile %10, %5 ve %1 önem düzeyini temsil etmektedir. Parantez içinde bulunann standart hatalar bootstrap yöntemi ile elde edilen dirençli standart hatalardır.*

Yolsuzluk seviyesinin, DAC ülkeleri tarafından verilen yardımlar üzerindeki etkisinin kantil regresyon analizi ile elde edildiği bulgular Tablo 3' de yer almaktadır. Buna göre, yolsuzluk seviyesi ve yardım seviyesi en düşük dilimde (tau=0.25) yer aldığı yani ülkelerin yolsuzluk seviyesi ve yardım düzeyleri ortalamanın altında olduğunda veya ortalama değer olduğunda (tau=0.50) yardımlar ile yolsuzluk seviyesi arasında istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki elde edilememektedir. Ancak yolsuzluk seviyesi ve yardımlar oldukça yüksek seviyede olduğunda (tau=0.75) yolsuzluktaki artışın yardımlarda artışa neden olduğu sonucuna varılmaktadır. Yardımlar için önem teşkil eden diğer açıklayıcı değişkenler değerlendirildiğinde ise GSYH seviyesinin ve yardımların alt dilimde yer aldığı durumda GSYH ve yardım arasında istatistiksel anlamlı bir ilişki bulunmazken ortalama ve üst dilimlerde GSYH seviyesindeki artışın yardımları negatif etkilediği sonucuna varılmaktadır. Ticaret değişkenini göre ise ortalama ve üst dilimde anlamlı bir ilişki bulunamazken, alt dilimde yani ticari ilişkilerin zayıf olması ile düşük yardım (tau=0.25) seviyesi arasında pozitif bir ilişki bulunmaktadır. İlgili dilimde ticaretteki artışların yardım seviyelerini arttıracaklarını söylemek mümkün olmaktadır. Kamu borçlarındaki artış sonrasında ise her üç dilimde de yardım seviyelerinin arttığı bu ilişkiyi istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif olduğu görülmektedir.

Tablo 4. Yolsuzluğun AB Üyesi Ülkeler Tarafından Verilen Yardımlara Etkisi

| | Yardım (AB) | | | | | |
|------------------|----------------|---------------------|----------------|---------------------|----------------|---------------------|
| | tau= 0.25 | | tau= 0.50 | | tau= 0.75 | |
| | <i>Katsayı</i> | <i>Prob. değeri</i> | <i>Katsayı</i> | <i>Prob. değeri</i> | <i>Katsayı</i> | <i>Prob. değeri</i> |
| Yolsuzluk | 2.0619 | 0.8091 | 8.5495 | 0.4734 | 18.7447 | 0.2740 |

| | | | | | | |
|----------------|----------|----------|-----------|--------|-----------|---------|
| | (8.5088) | | (11.8690) | | (17.0197) | |
| GSYH | -0.0137 | 0.2910 | -0.0403* | 0.0768 | 0.0048 | 0.9355 |
| | (0.0129) | | (0.0225) | | (0.0593) | |
| Ticaret | 1.5819 | 0.0412** | -0.4802 | 0.7804 | -5.2949 | 0.0874* |
| | (0.7623) | | (1.7169) | | (3.0599) | |
| Borç | 3.5241** | 0.0238 | 7.9419*** | 0.0086 | 4.1849 | 0.2564 |
| | (1.5297) | | (2.9472) | | (3.6612) | |

*Not: * ** *** sırası ile %10, %5 ve %1 önem düzeyini temsil etmektedir. Parantez içinde bulunann standart hatalar bootstrap yöntemi ile elde edilen dirençli standart hatalardır.*

Yolsuzluk seviyesinin AB üyesi ülkeler tarafından yapılan yardımlara duyarlılığının analiz edilmesi sonucunda elde edilen bulgular ise Tablo 4 de yer almaktadır. Yolsuzluk seviyesi ile AB üyesi ülkeler tarafından verilen yardımlar için her üç regresyon diliminde de istatistiksel açıdan anlamlı bir ilişki elde edilememektedir. GSYH seviyesi düşük veya üst dilimlerde yer aldığına yardımlarla ilişkili bir istatistiksel anlamlılık bulunamazken ortalama değerler arasında negatif bir ilişki olduğu görülmektedir. Ticaret değişkeni dikkate alındığında ise alt ve üst dilimlerde istatistiksel olarak anlamlı pozitif bir ilişki olduğu görülmektedir. Bu da daha düşük veya daha yüksek yardım dilimlerinde ticari ilişkilerin yardımlar açısından önem teşkil ettiğini göstermektedir. Kamu borçlarının ve yardımların yüksek dilimse olduğu regresyon sonucuna göre bu iki değişken arasında istatistiksel bir ilişki bulunamazken düşük ve orta seviyelerdeki kamu borçlarının ile yardımlar arasında pozitif bir ilişki olduğu sonucuna varılmaktadır.

6.SONUÇ VE DEĞERLENDİRMELER

2006-2016 yılları için yolsuzluk seviyesinin, DAC ve AB üyesi ülkeler tarafından yükselen piyasa ekonomilerine verilen yardımlar açısından önem teşkil edip etmediğinin panel kantil regresyon ile araştırıldığı bu çalışmada AB üyesi ülkelerin verdikleri yardımlar ile yolsuzluk seviyesi arasındaki ilişki için istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki elde edilememektedir. Literatürde yer alan çalışmalara göre AB üyesi ülkelerin yardımları daha az yolsuzluk yapan ülkelere yaptıkları vurgulanmaktadır. Bazı çalışmalarda ise AB ülkelerinin tamamı değil de İskandinav ülkeleri dikkate alınmış ve yardım yaparken yolsuzluk konusunda İskandinav ülkelerinin hassasiyeti vurgulanmıştır. Bu bağlamda, istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki bulunamaması AB ülkelerinin ülke özelinde farklılık gösterdiği ile bağlantılı olabileceği düşünülmektedir. DAC tarafından yapılan yardımlar dikkate alındığında ise yüksek düzeydeki yardımların yüksek düzeyde yolsuzlukla pozitif ilişkili olduğu sonucuna varılmaktadır. Bu sonuç, ortalamanın üstünde yolsuzluk seviyelerinin yüksek yardım düzeylerine eşlik ettiğini, DAC ülkelerinin ticari avantajlar sağlamak, doğal kaynak olanaklarına erişmek veya stratejik nedenlerle kalkınma finansmanlarını kullandıklarını göstermektedir. Bu durumda özellikle yüksek yardım seviyelerinde yardımların etkin bir şekilde kullanılmadığını, asıl hedefine ulaşmadığını söylemek mümkün olmaktadır. Yapılan yardımların denetlenmesinin önem teşkil ettiği sonucuna varılmaktadır.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

KAYNAKÇA

- Aldieri, L., Concetto, V.(2017). "Quantile Regression For Panel Data: An Empirical Approach For Knowledge Spillovers Endogeneity". MPRA Paper No. 76405.
- Alesina, A., Dollar, D. (2000). "Who Gives Foreign Aid To Whom And Why?" *Journal of Economic Growth*, 5 (1): 33-63.
- Alesina, A. & Weder, B. (2002). "Do Corrupt Governments Receive Less Foreign Aid". *American Economic Review*, 92 : 1126–1137.
- Asangu, S. (2012). "On The Effect of Foreign Aid on Corruption". A G D I Working Paper WP/12/031.
- Asangu, S., Jellal, M. (2013). "On The Channels of Foreign Aid to Corruption". African Governance And Development Institute A G D I Working Paper Wp/13/018
- Askarov, Z., & Doucouliagos, H. (2015). "Aid and Institutions in Transition Economies". *European Journal of Political Economy*, 38: 55-70.
- Bauhr, M., Charron, N., & Nasiritousi, N. (2013). "Does Corruption Cause Aid Fatigue? Public Opinion and the Aid-Corruption Paradox". *International Studies Quarterly*, 57(3):568-579.
- Bauhr, M, Charron, N. (2018). "Why support International redistribution? Corruption and Public Support for Aid in the Eurozone". *European Union Politics* 0(0): 1–22.
- Baum, C.(2013). Quantile Regression. Erişim:<http://fmwww.bc.edu/EC-C/S2013/823/EC823.S2013.nn04.slides.pdf>. (02.11.2018)
- Bütthe, T., Major, S. and de Mello e Souza (2012). "The Politics of Private Foreign Aid: Humanitarian Principles, Economic Development Objectives, and Organizational Interests in NGO Private Aid Allocation." *International Organization*, 66: 571–607.
- Bräutigam, D. A., & Knack, S. (2004). "Foreign Aid, Institutions, and Governance in Sub-Saharan Africa". *Economic Development and Cultural Change*, 52(2):255-285.
- Busse, M., & Gröning, S. (2009). "Does Foreign Aid Improve Governance?". *Economics Letters*, 104(2):76-78.
- Chong, A. Gradstein, M., Calderon, C. (2009). "Can Foreign Aid Reduce Income Inequality and Poverty?" *Public Choice*, 140 (1/2):59-84.
- Collier, D., Dollar, D.(2002). "Aid Allocation and Poverty Reduction". *European Economic Review*, 46:1475–1500.
- Dalgaard, C. and Olsson, O. (2008). "Windfall Gains, Political Economy and Economic Development". *Journal of African Economies* 17: 72–109.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Dang, H., Knack, S., Halsey, F. (2013). "International Aid and Financial Crises In Donor Countries". *European Journal of Political Economy*, 32: 232–250.
- Gibson, C., Hoffman, B., Jablonski, R. (2015). "Did Aid Promote Democracy in Africa? The Role of Technical Assistance in Africa's Transitions". *World Development*. 68: 323–335.
- Hanlon, J. (2004). "Do Donors Promote Corruption?: The Case Of Mozambique". *Third World Quarterly*, 25(4), 747-763.
- Isaksson, A. S., & Kotsadam, A. (2018). "Chinese aid and Local Corruption". *Journal of Public Economics*, 159: 146-159.
- Isopi, A., & Mattesini, F. (2010). "Aid and Corruption: Do Donors Use Development Assistance to Provide The "Right" Incentives". In *Aid Data Conference*, University College, Oxford, March (pp. 22-25).
- Kaufman, D. (2005). "Myths About Governance and Corruption". *Finance and Development*, September, 41-43.
- Khan, H., Hoshino, E. (1992). "Impact of Foreign Aid on the Fiscal Behavior of LDC Governments". *World Development*, 20(10):1481-1488.
- Knack, S. (2001). "Aid Dependence and the Quality of Governance: Cross-country Empirical Tests". *South. Econ. J.* 68 (2):310–329
- Knack, S. (2004). "Does Foreign Aid Promote Democracy?" *International Studies Quarterly*, 48 (1): 251-266.
- Koenker, R. (2000). This article has been prepared for the statistics section of the *International Encyclopedia of the Social Sciences* edited by Stephen Fienberg and Jay Kadane. The research was partially supported by NSF grant SBR-9617206.
- Koenker, R., Basett, G.(1978). "Regression Quantiles". *Econometrica*, 46(1), 35-50
- Menard, A. R., & Weill, L. (2016). "Understanding the Link between Aid and Corruption: A causality Analysis." *Economic Systems*, 40(2), 260-272.
- Okadaa, K., Samreth, S.(2012). "The Effect of Foreign Aid on Corruption: A Quantile Regression Approach". *Economics Letters* 115:240–243.
- Powell, D. (2016). *Quantile Regression with Nonadditive Fixed Effects*. Rand Corporation.
- Rajan, R. and Subramanian, A. (2007). "Does Aid Affect Governance?". *The American Economic Review*, 97(2):322-327

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Mahembe, Odhiambo (2017). "On the Link Between Foreign Aid and Poverty Reduction in Developing Countries". *Revista Galega de Economía*, 26 (2) 113

Menard, A., Weill, L. (2016). "Understanding the Link between Aid and Corruption: A causality Analysis". *Economic Systems*, 40(2):260-272

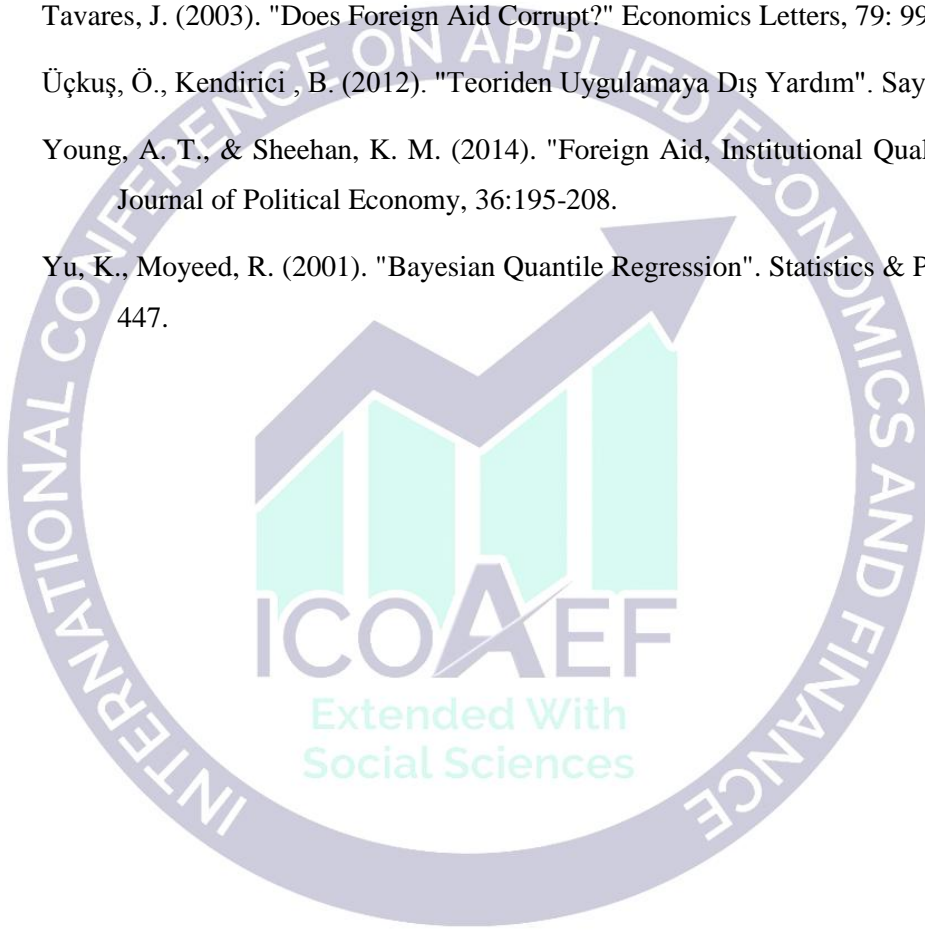
Okada, K. and Samreth, S. (2012). "The Effect of Foreign Aid on Corruption: A Quantile Regression Approach". *Economics Letters* 115: 240–243.

Tavares, J. (2003). "Does Foreign Aid Corrupt?" *Economics Letters*, 79: 99–106.

Üçkuş, Ö., Kendirici, B. (2012). "Teoriden Uygulamaya Dış Yardım". *Sayıştay Dergisi*, 86

Young, A. T., & Sheehan, K. M. (2014). "Foreign Aid, Institutional Quality and Growth". *European Journal of Political Economy*, 36:195-208.

Yu, K., Moyeed, R. (2001). "Bayesian Quantile Regression". *Statistics & Probability Letters* 54: 437 – 447.



GÖÇ: GİRİŞİMCİLİK VE BİLGİ TEKNOLOJİLERİNİN ETKİSİ

M. Kenan TERZİOĞLU*

Mehmet BULUT**

Eda Nur ERKUT***

ÖZET

Ülkeler arası farklı demografik özelliklerden, gelir farklılıklarından, küresel olarak yeniden yapılanan ekonomilerdeki değişimlerden kaynaklanan göç olgusu bireysel ve kitlesel yer değiştirme eğilimi olarak tanımlanmaktadır. Gelişen teknoloji ile ilişkili zamandan ve hammaddeden kar etme güdüsünü içinde barındıran sanayileşme, ekonomik kalkınma kapsamında göç hareketleri üzerinde etkili olmaktadır. Teknoloji düzeyindeki artışın ekonomide etkin olarak yer alabilmesi için ülkede inovasyon hareketlerinin ele alınması gerekmektedir. Teknoloji üretemeyen, teknolojiyi doğru transfer edemeyen ve üretim sürecine dâhil edemeyen ülkeler teknoloji yoksulluğu ile büyüme sürecini yavaşlatmaktadır. Üretim ölçeklerinin ve potansiyelinin etkin kullanılması durumunda beşeri sermaye de ekonomik büyüme sürecinde etkili bir faktör olmaktadır. Beşeri sermaye hem bilgi birikiminin artırılması hem de edinilen teknolojinin özümsemesi sürecinde etkin olmaktadır. Ülkelerin ekonomik olarak büyümesi ve kalkınması; refahın artmasıyla birlikte yaşam kalitesini de olumlu yönde etkilemektedir. Ekonomik kaynaklarının yeni yöntemlerle üretim faktörlerine dönüştürülmesi sonucunda ortaya çıkan yeni ürün ve servis sağlayıcılarıyla rekabeti arttırması, teknoloji kullanımıyla verimlilik ve istihdamda artış yaratması, ülkelerin ekonomik büyüme ve kalkınmalarında girişimcilik faaliyetlerini önemli bir etken olarak ortaya çıkarmaktadır. Sürdürülebilir ekonomik kalkınmaya sahip ve istihdam büyümesi yaratan ekonomilerde göç sorunsalı daha az ortaya çıkmaktadır. Bu bağlamda girişimcilik, bilgi teknolojileri ve göç olgusu eşanlı panel veri yöntemiyle incelenmektedir.

Anahtar Kelimeler: *Göç, Bilgi Teknolojileri, Girişimcilik, Çıktı Açığı, Eşanlı Panel Veri Analizi*

* Doç.Dr., Trakya Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, Ekonometri Bölümü, Ekonometri Anabilim Dalı, kenanterzioglu@trakya.edu.tr

** Yüksek Lisans, Trakya Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Ekonometri Anabilim Dalı, mbulut12@gmail.com

*** Yüksek Lisans, Trakya Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Ekonometri Anabilim Dalı, edaerkut@gmail.com

**MIGRATION: IMPACT OF ENTREPRENEURSHIP AND INFORMATION
TECHNOLOGIES**

ABSTRACT

The phenomenon of migration originating from different demographic characteristics, income differences and changes in globally restructured economies is defined as individual and mass displacement tendency. Industrialization, involving the profit-motive from raw material and the time associated with developing technology, has an impact on migration movements within the scope of economic development. Innovation movements in the country should be addressed in order to take the increase in technology level place in the economy effectively. Countries that cannot produce technology, cannot transfer technology correctly, and cannot be involved in the production process slow down the growth process with technology poverty. Human capital is also an effective factor in the process of economic growth in the case of efficient use of production scales and potential. Human capital is effective both in increasing knowledge and assimilating acquired technology. Economic growth and development of countries, within the increase in prosperity, also affects the quality of life positively. Increasing competition with new products and service providers resulting from the transformation of economic resources into new production factors and the increase in productivity and employment through the use of technology creates entrepreneurship activities as an important factor in the economic growth and development of countries. Migration rates emerge less in economies that have sustainable economic development and create employment growth, In this context, entrepreneurship, information technology and migration phenomenon are examined with simultaneously panel data method.

Key Words: *Migration, Information Technologies, Entrepreneurship, Output Growth, Simultaneously Panel Data Analysis*

1.GİRİŞ

Siyasal, toplumsal ya da ekonomik nedenlerle bireylerin ya da toplulukların buldukları yerleşim yerlerinden ayrılarak, başka yerleşim yerlerine gitmesi eylemi olarak tanımlanan göç, gelir ve istihdam gibi iktisadi ihtiyaçlara ve ekonomik fırsatlara ulaşılması açısından önemli olmaktadır(Parrado ve Cerrutti, 2003). İşgücünün yer değiştirmesi sonucunda ortaya çıkan göç, nitelik açısından emek arzını genişletebilmektedir. Yerli emeğin ikamesi olmak yerine emeği tamamlayıcı özelliğe sahip olan işgücü göçü emeğe kazandırma vasıtasıyla araştırma geliştirme (Ar-Ge) faaliyetlerini, girişimciliği, bilgi aktarımı vasıtasıyla da yeniliği teşvik etme özelliğine sahiptir. Yasal prosedürlere uygun olarak yapılan düzenli göç hareketliliğinde nitelikler daha kolay kullanılabilen ve işgücü piyasasına daha kolay uyum sağlanmaktadır. Yasal prosedüre uygun olmayan düzensiz göç hareketliliğinde ise bireysel vasıflar genellikle göç alan ülkenin işgücü piyasasına girişte kullanılamamaktadır. Göç hareketliliği

sonucu nüfusu gençleşen, işgücüne sahip olan, ekonomik faaliyet çeşitliliğine sahip ve sürdürülebilir kalkınması olan ülkeler bilim ve teknolojik ilerlemelerde ön plana çıkmaktadır(Nakhoul, 2014). Yeni ürünlerin üretilmesi ve süreçlerin geliştirilmesi, ihracat pazarlarının ve hammadde kaynaklarının bulunmasıyla, yeni birleşimlerin oluşumuyla ekonomik düzenin tekrardan kurgulanmasını sağlayan girişimcilik faaliyeti, kalkınma için ekonomik bir temel yaratarak sosyo-ekonomik gelişmenin işleyişini etkin bir hale getirmektedir(Döm, 2006). Gelir dağılımdaki adaletsizlik, bölgeler arası gelişmişlik farkı, artan işsizlik, yoksullaşma ve etkin bir rekabet ortamının olmaması üretim faktörleri arasında yer alan girişimcilik faktörünü piyasa ekonomilerinde öne çıkarmaktadır(Paleno ve Kleiner, 2000). Girişimciliğin temelinde yer alan inovasyon süreçlerinde bilim ve teknolojiye gelişmelerin piyasa ekonomisi üzerine olumlu etkileri olduğundan kalkınma üzerine odaklanılmaktadır(Kanellos, 2013).Ekonomik açıdan bakıldığında göçmenler göç ettikleri ülkelerin ekonomilerinde, iş piyasalarında iş sahibi olarak yer almakta ve iş sahibi göçmen girişimci olarak adlandırılmaktadır. Girişimciliğe daha yatkın olmakla birlikte yüksek eğitilmiş, belirli alanlarda uzmanlaşmış grubun, istenilen ücret düzeyine sahip olmama ya da bu ihtimalin çok düşük olduğu az gelişmiş ve gelişmekte olan ülkelere doğru göç etmesi sonucu girişimciliğe daha yatkın bir göçmen grubu ortaya çıkmaktadır. Kalkınmışlık düzeyi yüksek olan ülkelere girişimcilik faaliyetleri ön plana çıkmaktadır. Girişimcilik ile inovasyon doğru orantılı olarak ilerlemektedir. İnovasyon sürdürülebilir karlı büyüme sağlarken, bilgi birikiminin hızla artması kavramları ve kavrayışları ortaya çıkarmakta ve artan bu bilgiyle kurumların amaçları, yapıları, işlevleri yenilenmek zorunda kalmaktadır(Rogers, 2003). Bilgi ve sermayenin iş gücü ve doğal kaynakların önüne geçerek ekonominin temel kaynağı haline gelmesi, pazar beklentileri ve yeni ürün taleplerindeki değişim, bilgi yoğun firmalardaki sürdürülebilir rekabetin temel kaynağını bilgi ve yenilik olarak ortaya çıkarmaktadır(Johanessen, 1999). Değişim ve yenilenme sürecini ifade eden inovasyon; bir fikri, pazarlanabilir bir ürün /hizmete, yeni/geliştirilmiş bir üretim ve hizmet yöntemine dönüştürme olarak tanımlanmaktadır. Yenilik kavramı değişim kavramı ile ilişkili olmakla birlikte değişim kendiliğinden ortaya çıkarken, inovasyon planlanmaktadır. İnovasyonu geliştirmek için Ar-Ge faaliyetleri ile bilgi yaratılmakta ve başka alanlarda yapılan çalışmalardan ilham alınarak yenilikler sağlanmaktadır. Ülkeler Ar-Ge' ye önem vererek uygun iş gücünü yetiştirmekte ya da vasıflı elamana ihtiyaç duymaktadır. İhtiyaç duyulan vasıflı elemanların yetiştirilmesi için gereken süresinin uzaması ve yetiştirme maliyetinin yükselmesi emeğin diğer ülkelere karşılanmasına yani beyin göçünü beraberinde getirmektedir. Bu noktada ülkelerin eğitim, bilim, bilgi teknolojileri ve Ar-Ge çalışmalarına verdiği önem ile sunduğu olanaklar ön plana çıkmaktadır. İnovasyon test edilmemiş bir uygulamayı ve teknolojik yetkinlikleri kullanarak üretim yöntemlerini biçimlendirmek ve dönüştürmek olarak tanımlanmaktadır(Schumpeter, 1934).

Matricano ve Sorrentino (2014), göçmenlerin girişimcilerin motivasyonlarını itme ve çekme faktörleri açısından incelenmektedir. Zlotnik (1998), uluslararası göçün küresel ekonomik değişimde en

önemli faktörlerinden biri olduğunu ifade etmektedir. Wahlbeck (2007), göçmen işçilere kapalı iş gücü pazar yapısının göçmenleri kendi işlerini kurmaya yönlendirdiğini vurgulamaktadır. Baycan vd. (2006), etnik girişimcilik kapsamında girişimcilerin özelliklerini, girişimcilik motivasyonlarını, faaliyet gösterdikleri sektörleri, işgücü ve müşteri profilleri ve girişimcilikteki başarı kriterlerinin ortaya koymaktadır. Basu ve Altınay (2002), kültür ve girişimcilik etkileşimini göçmenlerin girişimcilik faaliyetleri çerçevesinde ele almaktadır. Sanders ve Nee (1996), beşeri sermayelerinin ve sosyal sınıflarının girişimcilik eğilimlerine etkilerini ortaya koymaktadır. Nişancı (2015), girişimcilerin girişimcilik eğilimlerinin ardında yatan faktörleri göçmen girişimcilik kapsamında incelemektedir. Ramadani vd. (2014), girişimcilerin girişimciliğe yönelmelerinin ardında yatan motivasyonlarını, iş başarılarını etkileyen faktörlerin, organizasyon yapılarının, finans kaynaklarının ve etnik ve sosyal sorumluluklarının neler olduğunu ortaya koymaktadır. Fatoki ve Patswawairi (2012), göçmen girişimcilerin itme ve çekme teorisi kapsamında motivasyon faktörlerini ve onların performanslarını etkileyen engelleri göstermektedir. Kültürel çeşitliliğin bölgelerin ve şehirlerin yenilikçilik veya verimlilik oranları üzerindeki etkisini inceleyen birçok çalışma bulunmaktadır (Ottaviano ve Peri, 2005; Niebuhr, 2010; Bellini vd., 2013; Ozgen vd., 2013; Cooke ve Kemeny, 2016; Beine, vd., 2008; Boeri vd., 2012). Clemens (2015), göçmenlerin sosyal ağlar, geçici ya da kalıcı geriye dönüşler ve doğrudan yabancı sermaye yatırımları gibi çeşitli araçlar kullanarak buldukları ülkelerden anavatanlarına ne şekilde bilgi ve teknoloji transferi gerçekleştirebileceklerini göstermektedir. Borjas (2004), Hunt ve Gauthier Loisele (2010), Hunt (2015), göçmen bilim adamlarının ve mühendislerin diğer göç alan ülkelerin beşeri sermaye stoklarını nasıl genişletebileceklerine göstermektedir. Chen (2005), stokastik dinamik modelle kaynağın açısından göçün ekonomik büyüme üzerine etkilerini vurgulamaktadır. Kavak (2009), bilgi üretebilmek ve bilgiyi değere dönüştürebilmenin inovasyon ile mümkün olabileceğini ifade etmektedir. Elçi (2007), ülkelerin ekonomik olarak güçlü olabilmeleri, rekabet güçlerine bağlı olduğunu vurgulamaktadır. Kurtulmuş (1992), Ar-Ge faaliyetlerine yapılan yatırımlar, yüksek nitelikli eleman konusunda sürekli olarak arzın üstünde talebin olmasına yol açmaktadır. Shaw (2005), inovasyon yeteneğini etkileyen kurumsal girişimciliğin farklı yapılarını göstermektedir. McFadzean (2005), inovasyon ve girişimcilik arasındaki bağlantıyı vurgulamaktadır. Kılınç (2015), ülkelerin girişimcilik ve inovasyon konusundaki performansını incelemektedir. Audretsch (2008), bölgesel ekonomik performansta bölgesel inovasyon çabalarının ve girişimciliğe dayalı bilginin etkilerini göstermektedir. Küçükaltan (2009), girişimciliğin inovasyonu kullanarak ekonomiye ve sosyal hayata sürekli olarak yeni ürünler sunduğunu ifade etmektedir. Prystrom (2017), yerel yönetimlerin inovasyon girişimlerinin aktif katılımı olmadan başarı şansının olmadığını vurgulamaktadır.

Ülkelerin ulusal Ar-Ge sistemlerini genişletebilecek, piyasalarını uluslararası piyasa ile bütünleştirebilecek, girişimcilik seviyesini yükseltebilecek göç veren ve alan ülkeler arasındaki etkileşim ile uluslararası iş bölümünü iyileştirecek ve bölgesel işgücü arzı kısıtlılarının

aşılmasını (teknolojik gelişme ve sanayileşmede iyileşme) sağlayabilecek yüksek nitelikli iş gücünün göç ile temin edebileceği vurgulanmaktadır. Bu çalışma kapsamında göç olgusunda girişimcilik ve bilgi teknolojilerinin etkisi incelenmektedir.

2.PANEL EŞANLI MODELLER

Zaman boyutuna sahip yatay kesit veriler kullanılmak suretiyle oluşturulan panel veriler birimler arasındaki heterojenliğin dikkate alınmasını ve hem birim hem de zaman etkilerinin birlikte gözlemlenebilmesini sağlamaktadır (Baltagi, 2012). Yatay kesit birimlerini i indisi, zaman periyodunuda t indisi göstermek üzere, Y bağımlı değişkeni ile X bağımsız değişkenlerinden oluşan bir panel veri modeli

$$Y_{it} = \alpha_{it} + \beta_{1it}X_{1it} + \dots + \beta_{kit}X_{kit} + u_{it} \quad i = 1, \dots, N \quad t = 1, \dots, T \quad k = 1, \dots, K \quad (1)$$

şeklinde gösterilmektedir. Değişkenler arasında karşılıklı ilişkileri ortaya çıkaran eşanlı denklem modelleriyle iktisadi olayların karmaşık yapıları daha iyi çözümlenebilmektedir. Y_j , $NT \times g_j$ ve X_j ise $NT \times (k_j) + 1$ boyutunda bir matris olmak üzere

$$Y_j = Y_j\beta_j + X_j\gamma_j + u_j \quad (2)$$

şeklinde ifade edilmektedir. Tüm içsel ve dışsal değişkenler $Z_j = [Y_j, X_j]$ ve parametreler de $\delta_j' = [\beta_j', \gamma_j']$ şeklinde iken eşanlı denklem modelinin j . yapısal kalıp denkleminde ait matris gösterimi,

$$Y_j = Z_j\delta_j + u_j \quad (3)$$

olmaktadır. $NT \times (M_j - 1)$ boyutlu j . denklemde yer alan içsel değişkenlerin matrisini Y_j , $NT \times K_j$ boyutlu j . denklemde yer alan dışsal değişkenlerin matrisini X_j , denklemin sağ tarafında yer alan içsel ve dışsal değişkenlerin bir araya toplandığı matrisi $Z_j = [Y_j, X_j]$ ve j . yapısal denklem için içsel ve dışsal değişken parametrelerini $\delta_j' = (\gamma_j', \beta_j')$ göstermek üzere eşanlı denklem sistemindeki j . yapısal denklem

$$y_j = Y_j\gamma_j + X_j\beta_j + u_j = Z_j\delta_j + u_j \quad j = 1, 2, \dots, M \quad (4)$$

şeklinde yazılmaktadır. $Z_\mu = I_N \otimes I_T$, $Z_\lambda = I_N \otimes I_T$, $\mu_j' = (\mu_{1j}, \mu_{2j}, \dots, \mu_{Nj})$, $\lambda_j' = (\lambda_{1j}, \lambda_{2j}, \dots, \lambda_{Nj})$ ve $v_j' = (v_{1j}, v_{2j}, \dots, v_{Nj})$ olmak üzere, birimlerin gözlemlenemeyen etkisi $u_j = Z_\mu\mu_j + v_j$ ve zamanın gözlemlenemeyen etkisi $u_j = Z_\lambda\lambda_j + v_j$ hata teriminin bileşeni olarak ele alınmaktadır. $\Omega_{jj} = \sigma_{\mu jj}^2(I_N \otimes J_T) + \sigma_{v jj}^2(I_N \otimes J_T)$, varyans kovaryans matrisi kullanılarak, $Z_j^* =$

$\Omega_{jj}^{-1/2} Z_j$, $Y_i^* = \Omega_{jj}^{-1/2} y_j$ ve $P_{x^*} = X^*(X^{*'} X^*)^{-1} X^{*'}$ olmak üzere, panel eşanlı modelleri için, genelleştirilmiş iki aşamalı en küçük kareler tahmincisi,

$$\delta_{j,G2SLS} = [Z_j^{*'} P_{x^*} Z_j^*]^{-1} Z_j^{*'} P_{x^*} y_j^* \quad (5)$$

olarak elde edilmektedir (Baltagi, 2009). $Y' = (Y_1', \dots, Y_M')$, $Z = \text{diag}[Z_j]$, $\delta' = (\delta_1', \dots, \delta_M')$, $v' = (v_1', \dots, v_M')$ ve $Z_j = [Y_j, X_j]$ olmak üzere;

$$Y = Z\delta + v \quad (6)$$

$$v_j = Z_\mu \mu_j + u_j \quad (7)$$

olduğunda varyans kovaryans matrisi

$$\Omega = E(vv') = \Sigma_\mu \otimes (I_N \otimes J_T) + \Sigma_u \otimes (I_N \otimes I_T) \quad (8)$$

olarak hesaplanmaktadır. Eşitlik (6) ile $(I_M \otimes Q)$ çarpılıp gruplar içi dönüşüm yapıldığında

$$\tilde{y} = \tilde{Z}\delta + \tilde{v} \quad (9)$$

eşitliğine üç aşamalı EKK uygulandığında, $\tilde{X} = PX$ olmak üzere,

$$\hat{\delta}_{G13AEKK} = [(\tilde{Z}' \Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}}) \tilde{Z}]^{-1} [(\tilde{Z}' \Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}}) \tilde{y}] \quad (10)$$

şeklinde grup içi üç aşamalı EKK tahmin edicisi elde edilmektedir. $\bar{y} = (I_M \otimes P)Y$, $\tilde{Z} = (I_M \otimes P)Z$ ve $\bar{v} = (I_M \otimes P)v$ olmak üzere Eşitlik (6) ile $(I_M \otimes P)$ çarpılıp gruplar arası dönüşüm yapılarak

$$\bar{y} = \tilde{Z}\delta + \bar{v} \quad (11)$$

eşitliğine üç aşamalı EKK uygulandığında, $\bar{X} = PX$ olmak üzere,

$$\tilde{\delta}_{G13AEKK} = [(\tilde{Z}' \Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}}) \tilde{Z}]^{-1} [(\tilde{Z}' \Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}}) \bar{y}] \quad (12)$$

gruplar arası üç aşamalı en küçük kareler tahmincisine ulaşılmaktadır. Dönüştürülen Eşitlik (9) ve Eşitlik (11) sırasıyla $(I_M \otimes \tilde{X}')$ ve $(I_M \otimes \bar{X}')$ ile çarpılıp bir sistem olarak genelleştirilmiş en küçük kareler uygulandığında

$$\tilde{\delta}_{1,TE3AEKK} = [\tilde{Z}' (\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}}) \tilde{Z} + \bar{Z}' (\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}}) \bar{Z}]^{-1} * \tilde{Z}' (\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}}) \tilde{Z} + \bar{Z}' (\Sigma_u^{-1} \otimes P_{\tilde{x}}) \bar{y}] \quad (13)$$

tesadüfi üç aşamalı EKK tahmincisi elde edilmektedir(Tatoğlu,2012).

3.GÖÇ, GİRİŞİMCİLİK VE BİLGİ TEKNOLOJİLERİNİN ETKİLEŞİMİ

Sanayileşme, girişimcilik ve teknolojiadaki ilerlemeler sonucunda ülkeler arasında ortaya çıkan gelişmişlik düzeyleri arasında çıkan fark ülkelerin büyümelerine ve sürdürülebilir kalkınmalarını etkileyerek, göç hareketliliğinin oluşmasına neden olan etkenler arasında yer almaktadır. Bu çalışmada Belçika, Danimarka, Fransa, Almanya, Yunanistan, İrlanda, İtalya, Hollanda, Portekiz, İspanya, İsveç, Birleşik Krallık olmak üzere 12 AB ülkesi ve Türkiye için göç, girişimcilik ve bilgi teknolojileri arasındaki ilişkinin varlığı eşanlı panel veri analizi kullanılarak araştırılmaktadır. Etkileşimin ortaya çıkarılmasında kullanılan göç, girişimcilik, Ar-Ge ve patent sayıları, sanayileşme oranı, teknolojiye yapılan yatırımlar, enerji kullanımı, yüksek teknoloji ihracatı ve eğitim harcamalarına ait veri setleri Central Intelligence Agency (CIA), OECD, Global Entrepreneurship Monitor (GEM) ve Dünya Bankası'ndan elde edilmektedir.

Ekonometrik analizler yapılmadan önce serilerin sabit olup olmadıkları incelenmeli, sonuçların sapmalı ve yanıltıcı olmaması adına durağanlık testinin uygulanması gerekmektedir. Paneli oluşturan yatay kesitlerin birbirinden bağımsız olup olmadıkları panel birim kök sınavında önemlidir. Durağanlık sınavı için kullanılan panel birim kök testleri birinci ve ikinci kuşak testler olarak ikiye ayrılmaktadır. Panel birim kök testleri de kendi içinde iki gruba ayrılmaktadır. Birinci kuşak testler, birimler arasında korelasyon olmadığını varsaymaktadır. İkinci kuşak panel birim kök testlerinin temel özelliği ise, birimlere ait seriler arasında korelasyon olduğunu varsaymaktadır. Birinci kuşak birim kök testleri, paneli oluşturan yatay kesit birimlerinin bağımsız olduğu ve paneli oluşturan birimlerden birine gelen şoktan tüm yatay kesit birimlerinin aynı düzeyde etkilendikleri varsayımına dayanmaktadır. Bununla beraber, paneli oluşturan yatay kesit birimlerinden birine gelen bir şoktan birimlerin farklı düzeyde etkilenmesi daha gerçekçi bir yaklaşım olduğundan yatay kesit bağımlılığını göz önünde bulundurarak birim kök analizi yapan ikinci kuşak birim kök testler kullanılmaktadır. Bu çalışmada birinci kuşak testlerinden Levin, Lin ve Chu, Breitung, Im, Pesaran ve Shin, Hadri LM, Harris-Tzavalis, Fisher PP ve Fisher ADF testleri, ikinci kuşak testlerinden ise Pesaran's CADF testi kullanılmaktadır.

Tablo 1.'de Levin, Lin ve Chu, Breitung, Im, Pesaran ve Shin, Hadri LM, Harris- Tzavalis, Fisher PP ve Fisher ADF birinci kuşak panel birim kök ve ikinci kuşak Pesaran CADF testlerine göre, ileri teknoloji ihracatı, göç, girişimcilik, sanayileşme, Ar-Ge ve patent, teknolojiye yapılan yatırım, eğitim harcamaları ve enerji kullanımı değişkenlerinde birim kök bulunmadığından seriler durağan olmaktadır. Tutarlı tahminciler elde edilebilmek için çalışmada üç aşamalı en küçük kareler yöntemi kullanılmaktadır.

Tablo 1. Panel Birim Kök Testi Sonuçları

| | G | YTI | GR | S |
|---------------------|------------|------------|------------|------------|
| | I(0) | I(0) | I(0) | I(0) |
| Levin,Lin ve Chu | -0.009** | -12.0017** | -14.8824** | -3.08718** |
| Harris ve Tzavalis | -1.83618** | -0.30726** | -16.3809** | -1.89288** |
| Breitung | -1.73286** | 3.5586** | -12.3174** | -5.75118** |
| Hadri | 4.24638** | 11.44692** | -2.00538** | 4.53942** |
| Im,Pesaran,Shin | -0.009** | -5.44428** | -8.94636** | -12.2168** |
| Fisher PP | | | | |
| Inverse X^2 | 6.1443** | 1.95642** | 12.54582** | 13.70592** |
| Inverse normal | -6.95412** | 2.42118** | -8.8353** | -15.6593** |
| Inverse logit | -15.5642** | 2.1528** | -9.00504** | -5.5467** |
| Modified inv. X^2 | -7.23114** | -1.22634** | 10.72602** | 4.19724** |
| Fisher ADF | | | | |
| Inverse X^2 | 1.82376** | 10.4364** | 5.175** | 8.89038** |
| Inverse normal | 5.0625** | -4.4415** | -1.07604** | -1.93842** |
| Inverse logit | 5.49108** | -13.9468** | -1.19088** | -2.457** |
| Modified inv. X^2 | -1.2447** | 11.90106** | 0.71766** | 4.47786** |
| | EH | AP | TYT | EK |
| | I(0) | I(0) | I(0) | I(0) |
| Levin, Lin ve Chu | -11.903** | -12.6684** | -15.7092** | -13.6519** |
| Harris ve Tzavalis | -12.3912** | -0.32433** | -17.291** | -7.64902** |
| Breitung | -7.91136** | 3.7563** | -13.0017** | -2.90377** |
| Hadri | 2.68902** | 12.08286** | -2.11679** | 16.0778** |
| Im,Pesaran, Shin | -6.95736** | -5.74674** | -9.44338** | -6.43454** |
| Fisher PP | | | | |
| Inverse X^2 | 9.4464** | 2.06511** | 13.24281** | 15.49602** |
| Inverse normal | -7.3656** | 2.55569** | -9.32615** | -4.59496** |
| Inverse logit | -7.2702** | 2.2724** | -9.50532** | -8.46963** |
| Modified inv. X^2 | 8.0496** | -1.29447** | 11.32191** | 14.26919** |
| Fisher ADF | | | | |
| Inverse X^2 | 5.5647** | 11.0162** | 5.4625** | 6.13206** |
| Inverse normal | -4.24008** | -4.68825** | -1.13582** | -0.25194** |
| Inverse logit | -4.07394** | -14.7216** | -1.25704** | -0.99427** |
| Modified inv. X^2 | 3.2679** | 12.56223** | 0.75753** | 2.69477** |

(*,**,*** sırasıyla %1, %5 ve %10 önem düzeylerini ifade etmektedir).

Yüksek teknoloji ihracatı (YTI), göç(G), girişimcilik(GR), sanayileşme(S), Ar-Ge ve patent(AP), teknolojiye yapılan yatırım(TYY), eğitim harcamaları (EH) ve enerji kullanımı(EK) değişkenleri arasındaki ilişkinin ortaya çıkarılması için eşanlı panel modeli,

$$G_{it} = \beta_{11}YTI_{it} + \beta_{12}GR_{it} + \beta_{13}S_{it} + \beta_{14}EK_{it} + u_{1it}$$

$$GR_{it} = \beta_{21}G_{it} + \beta_{22}YTI_{it} + \beta_{23}S_{it} + \beta_{24}EH_{it} + u_{2it}$$

$$YTI_{it} = \beta_{31}G_{it} + \beta_{32}GR_{it} + \beta_{33}S_{it} + \beta_{34}AP_{it} + u_{3it}$$

$$S_{it} = \beta_{41}G_{it} + \beta_{42}YTİ_{it} + \beta_{43}GR_{it} + \beta_{44}TYT_{it} + u_{4it}$$

şeklinde kurulmaktadır. Model yapısı kapsamında, göç, girişimcilik, yüksek teknoloji ihracatı ve sanayileşme oranı değişkenleri içsel değişkenler olurken, Ar-Ge ve patent, teknolojiye yapılan yatırım, eğitim harcamaları ve enerji kullanımı değişkenleri dışsal değişken olmaktadır. Tablo 2’de üç aşamalı EKK yöntemi kullanılarak elde edilen sonuçlar gösterilmektedir.

Tablo 2. Sabit Etki Üç Aşamalı EKK Tahmini

| Göç | | Yüksek Teknoloji İhracatı | |
|-----------------------------------|------------|-----------------------------------|-----------|
| YTİ | -0.0129** | G | -0.4570** |
| GR | -0.2126** | GR | 0.8643** |
| S | -0.4584*** | S | 1.0314** |
| EK | -0.4032** | AP | 1.2456** |
| $R^2 = 69.67$ Wald test: 372.40** | | $R^2 = 67.43$ Wald test: 402.21** | |
| Girişimcilik | | Sanayileşme | |
| G | -0.0908** | G | 0.5092*** |
| YTİ | 0.8341*** | YTİ | 1.6540** |
| S | 0.0908** | GR | 0.6574** |
| EH | 0.9385** | TYT | 0.3087** |
| $R^2 = 65.67$ Wald test: 249.31** | | $R^2 = 71.03$ Wald test: 329.64** | |

(* , ** , *** sırasıyla %1, %5 ve %10 önem düzeylerini ifade etmektedir).

İstatistiksel olarak %5 anlam düzeyinde, yüksek teknoloji ihracatındaki, girişimcilikteki, sanayileşme oranındaki ve enerji kullanımındaki artış göç üzerinde istatistiksel olarak anlamlı ve negatif etki yaratmaktadır. Göç yüksek teknoloji ihracatını anlamlı ve negatif etkilerken, girişimcilik, sanayileşme ve Ar-Ge ve patent yüksek teknoloji ihracatını istatistiki olarak anlamlı ve pozitif etkilemektedir. Ülkeden göç hareketinin olması girişimciliği istatistiki olarak anlamlı ve negatif etkilerken, teknoloji ihracatı, sanayileşme ve eğitim harcamaları girişimciliği istatistiki olarak anlamlı ve pozitif etkilemektedir. Göçün, ihracatın, girişimciliğin, ve teknolojiye yapılan yatırımların sanayileşme üzerindeki etkisi istatistiki olarak anlamlı ve pozitif olmaktadır. Modelin genel anlamlılığını sınavan Wald testi anlamlı ve modelle ilgili R^2 değerleri sırasıyla %70, %67, %66 ve %71 olarak elde edilmektedir.

4.SONUÇ

Gelişmekte olan toplumlar öncelik ve önem sıraları değişse bile sürdürülebilir bir kalkınmaya ulaşmayı arzu etmektedir. Ekonomik ve sosyal gelişim için eğitim ve teknolojik ilerlemeler önem arz etmektedir. Eğitim kalitesinin iyi düzeyde olduğu ülkelerde teknolojik gelişmeler ve sanayileşme ile birlikte girişimcilik hareketleri de pozitif etkilenmektedir. Bilginin, becerinin, tekniğin ve entegrasyonun ortaya çıkmasından doğan teknoloji; üretimde verimliliğin artması, rekabet edebilme üstünlüğünün sağlanması ve kâr oranlarının artışında önemli bir faktör olmakta ve yarattığı etkiler

bakımından gelişmişlik düzeyinde önemli rol oynamaktadır. Teknolojik gelişmeler, eğitim düzeyi ve girişimcilik faaliyetleri kalkınma ile doğru orantılı ilerlemekte ve ülkelerin kalkınma düzeyi arttıkça dış ülkelere olan göç azalmaktadır.

İleri teknoloji ile birlikte ihtisaslaşmış bilim ve ileri tarzda bir idare/yönetim anlayışı ekonomik anlamda modernleşmeyi göstermektedir. Teknolojik kapasitenin yükseltilebilmesi için Ar-Ge faaliyetlerinin geliştirilmesi, sanayi, araştırma kuruluşları, üniversiteler ve araştırmacıların işbirliği ve eşgüdümünü sağlayacak önlemler getiren faaliyet alanlarının etkin ve dinamik bir biçimde planlanması ve kullanılması gerekmektedir. Ar-Ge ve yenilik faaliyetleri daha üst teknolojiler konusunda stratejik güç unsuru olmaktadır. Ar-Ge faaliyetlerinden kaynaklanan inovasyonlar büyüyen ekonominin temelini oluşturmakta ve beşeri sermaye ile ekonomik büyüme arasında olumlu bir ilişki ortaya koymaktadır. Yüksek teknoloji ihracatındaki artış ekonomik büyümeye katkı sağlamakta ve dışa doğru olan göçü azaltıcı nitelikte olmaktadır. Bununla birlikte ekonomik gelişme de yüksek teknoloji ihracatına pozitif yönde katkı sağlamaktadır.

Küresel üretim ve pazarlamanın yaygınlaşması o ülkedeki rekabeti arttırmaktadır. Bu durumda girişimcilik ülkelerin varlığını sürdürebilmesi için ön plana çıkmaktadır. Ülkelerin nitelikli işgücü kaybı sonucu girişimcilikte azalma ortaya çıkması göç veren ülkelerin ekonomik istihdam ve refah düzeyinin gelişmiş ülkelere nazaran daha düşük olmasını tetiklemektedir. Ekonomik kalkınmanın sağlanamadığı ve rekabetin olmadığı bir ortamda teknoloji ve sanayileşmenin de gelişmesi güçleşmektedir. Beşeri sermayenin ve ekonomik büyümenin sanayileşmeyi arttırdığı piyasalarda girişimcilik olumlu yönde etkilenmektedir. Çalışma kapsamında dışa olan göçün artışı girişimcilik hareketlerini negatif yönde etkilemektedir. Göç alan ülkelere ise sanayileşmenin gelişmiş olduğu gözlemlenebilmektedir. Sermaye birikimi, teknolojik gelişme ve istihdam artışının önemli kaynaklarından birini oluşturduğundan ekonomik büyüme ve sosyal gelişme süreçlerinde kritik bir önem taşımaktadır. Bununla birlikte sanayileşme ile beraber küresel iklim değişikliği de sosyal ve çevresel dengeyi etkilemektedir. Bu nedenle, yapılması planlanan çalışmalarda CO₂ emisyonundaki artışın göç hareketliliği üzerindeki etkisinin sanayileşme süreciyle birlikte incelenmesi planlanmaktadır.

KAYNAKÇA

- Aksoy, Z.; (2012). "Uluslararası Göç Ve Kültürlerarası İletişim", Uluslararası Sosyal Araştırmalar Dergisi, 5(20): 292-303.
- Audretsch, D. B., Bonte, W., & Keilbach, M. (2008); Entrepreneurship Capital And Its Impact On Knowledge Diffusion And Economic Performance.
- Aytaç, Ö.; (2006); Girişimcilik:Sosyo-Kültürel Bir Perspektif, Dumlupınar Üniversitesi, Sosyal Bilimler Dergisi, S:15, S.139-160.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Baltagi, Badi H.; (2005), *Econometric Analysis Of Panel Data*, Third Edition, Chichester: Wiley.

Baltagi, B. H. (2012); *Econometric Analysis Of Panel Data*

Başar, Mehmet; (2013) “Girişimcilik Ve Girişimcilik Süreçleri”, *Girişimcilik*, (Ed.Yılmaz Ürper), Anadolu Üniversitesi Yayını, No: 3002, Ss. 2-19.

Baycan Levent,T.; Kundak,S.; (2006), “İsviçre'nin Girişimci Türkleri”, *Uluslararası Girişimcilik Kongresi*, Manas Üniversitesi Bildiri Kitabı, Bişkek, S.405-418.

Beine, M., Docquier, F., & Rapoport, H. (2008), *Brain Drain And Human Capital Formation In Developing Countries: Winners And Losers*

Binks, Martin.-Vale, Philip; (1990). *Entrepreneurship And Economic Change*, Mcgrawhill Book Company.

Bozkurt, Özlem Ç.; (2011) *Dünyada Ve Türkiye'de Girişimcilik Eğitimi: Başarılı Girişimciler Ve Öğretim Üyelerinden Öneriler*, Detay Yayıncılık, Ankara.

Chen, H.J.; (2006), “International Migration And Economic Growth: A Source Country Perspective”

Cooke&Kemeny; (2016), *Immigrant Diversity And Complex Problem Solving*

Çakıcı, A.; (2003), ‘Mersin’deki Kadın Girişimcilerin Kurma Öyküsü Ve Kuracak

Kadınlara Öneriler’, 11. Yönetim Ve Organizasyon Kongresi Bildiriler Kitabı, Afyonçavuşoğlu, H.; (2006). *Uluslar Arası Göç Nedenleri, Tipleri, Türleri Ve Göçmenler*, Www.Balgoc.Org

Çelik, A.; (2006); *Bir İstihdam Politikası Olarak Girişimcilik*, Uluslararası Girişimcilik Kongresi, Mayıs 2006, Bişkek, 467-474.

Çetiner, M.A.; (Mayıs 1974). *Türkiye’de Turhan Oğuzkan Araştırması Dışında Beyin Gücü Göçü Konusunda Yapılan Diğer Araştırmalar Üzerindebir İnceleme*. Yüksek Lisans Seminer Çalışması. Ankara: Ankara

Üniversitesi Eğitim Fakültesi Özel Eğitim Bölümü.

Demircan, K.; (2006), “The Role Of R&D And Innovation In Us Economy Asa Benchmark

For Turkish Economy”, [Http://Www.Ekonomi.Gov.Tr/Upload/Bf09ae98-D8d3-8566-4520b0d124e5614d/Koray_Demircan.Pdf](http://Www.Ekonomi.Gov.Tr/Upload/Bf09ae98-D8d3-8566-4520b0d124e5614d/Koray_Demircan.Pdf)

Drucker, P. F.; (1985); *İnnovation And Entrpreneurship*, Harper &Row, Publishers.

Doğan, S.; (2010), “Avrupa Birliği’nin Girişimcilik Politikası-Kobi Yaklaşımı Vetürkiye”,

İstanbul Ticaret Odası Avrupa Birliği Araştırmaları, [Http://Www.İto.Org.Tr/İtoyayin/0022458.Pdf](http://Www.İto.Org.Tr/İtoyayin/0022458.Pdf)

Döm, Serpil; (2006), *Girişimcilik Ve Küçük İşletme Yöneticiliği*, Detay Yay., Ankara

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Elçi, Şirin (2006), İnovasyon: Kalkınmanın Ve Rekabetin Anahtarı Fatoki Ve Patswawairi; (2012) ,“The Motivations And Obstacles To Immigrant Entrepreneurshipin South Africa”

Friedberg, Rachel M. And Jennifer Hunt; (1995), “The Impact Of Immigrants On Host Country Wages, Employment And Growth”

George J. Borjas; (2004),The Labor-Market Impact Of High-Skill Immigration

George J. Borjas; (2009), Economic Well-Being Of The Elderly Immigrant Population

Güvenek, Burcu Ve Volkan Alptekin (2010). “Enerji Tüketimi Ve Büyüme İlişkisi: Oecd Ülkelerine İlişkin Bir Panel Veri Analizi”

Hunt & Gauthier-Loiselle; (2010), How Much Does Immigration Boost Innovation?

I.P. Ottaviano And Giovanni Peri; (2005), The Economic Value Of Cultural Diversity: Evidence From Us Cities Gianmarco Johannessen, J., Olaisen, J. And Olsen, B.; (1999), “Managing And Organizing Innovation İn The Knowledge”, European Journal Of Innovation Management 2 (3): 116±128

Kavak, Ç.; (2009) “Bilgi Ekonomisinde İnovasyon Kavramı Ve Temel Göstergeleri” akademik Bilişim’09 - XI. Akademik Bilişim Konferansı Bildirileri.

Harran Üniversitesi.Şanlıurfa Kılınç Efe Can; (2015), Girişimcilik Ve İnovasyon İlişkisi: Teorik Bir Değerlendirme

Korkmaz Turhan; (2010), Fvfm’nin İmkb Ulusal 100 Endeksindeki Geçerliliğinin Panel Veri Analizi İle Test Edilmesi

Kurtulmuş, N. (2012). Gelişmekte Olan Ülkeler Açısından Stratejik İnsan Sermayesi Kaybı: Beyin Gücü

Küçükaltan, D.; (2009) “Girişimcilik Ve Girişimci Kavramları” Trakya Üniversitesi, İktisadi Ve İdari Bilimler Fak., İşletme Bölümü.Edirne

Martin, P. L.; (2012) “Göç, Ticaret Ve Kalkınma: Meksika-Abd Ve Türkiye-Avrupa Karşılaştırması”, Migration Letters, 9(4), 401-414.121-136.

Nakhoul; (2014) Uluslararası İşgücü Göçü Ve Türkiye Çsgb Uzmanlık Tezi, Ankara.

Nee, Victor, Jimmy Sanders, And Scott Sernau. (1994).; "Job Transitions İn An Immigrant Me- Tropolis: Ethnic Boundaries And The Mixed Economy."

Niebuhr, (2010), Cultural Diversity And Entrepreneurship: A Regional Analysis For Germany

Nişancı, Z. N.; (2015). “Göçmen Girişimcilik Üzerine: Pittsburgh’daki Türk Girişimciler”, Girişimcilik Ve Kalkınma Dergisi, 10(1): 1-28.

Nişancı, Z. N., Oğrak, A., Ve Özmutaf, N. M.; (2015). “Amerika’da Yaşayan Türk

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Kökenli Girişimcilerin Girişimcilik Nitelikleri Kapsamında Algıları: Pittsburgh Gıda Sektöründe Bir Araştırma”, Kastamonu Üniversitesi İktisadi Ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, (10): 28-44.

Paleno, D. Ve B.H. Kleiner; (2000), □An Entrepreneurial Decision Proces Model Describing Opportunity Recognition, European, Journal Of Innovation Management, 9(1), Ss.61-78

Parrado, Emilio, A. Ve Marcela Cerrutti; (2003), “ Labor Migration Between Developing Countries: The Case Of Paraguay And Argentina”, International Migration Review, Vol:37, No:1, Spring Ss: 101-132.

Pazarlıoğlu, M.V.; (2007). İzmir Örneğinde İç Göçün Ekonometrik Analizi. Yönetim Ve Ekonomi Celal Bayar Üniversitesi İktisadi Ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi, 14(1)

Prystrom, J. Innovative Local Government As A Determinant Of Regional Development. Sosyal Bilimler Araştırma Dergisi, 6(2), 1-10.

Rogers, E. M.; (2003). Diffusion Of Innovations. Free Pres: New York

Shaw Elizabeth ,Andrew O'loughlin,Elspeth Mcfadzean, (2005), "Corporate Entrepreneurship And Innovation

Shaw, J. D., Gupta, N., & Delery, J. E. 2005. Voluntary Turnover And Organizational Performance

Sorrentino And Marioand Diego Matricano; (2014), Ukrainian Entrepreneurship İn Italy: Factors İnfluencing The Creation Of Ethnic Ventures

Tatoğlu, F.Y. (2012). Panel Veri Ekonometrisi

Özkul, G; (2008). Girişimcilik Teorileri Ve Girişimcilik Tipleri Antalya-Burdur-Isparta (İbbs Düzey 2 Tr61 Bölgesinde) İllerinde İmalat Sanayi Kobilerindeki Girişimciler Üzerine Bir İnceleme, Yayınlanmamış Yüksek Lisans Tezi, Süleyman Demirel Üniversitesi,Isparta.

Taş, A. Ve Çitçi, U. S; (2009). “Göçmen Girişimcilerin Girişimsel Yolculukları:

Türkiye'deki Balkan Girişimciler”, 1. Uluslararası Balkanlarda Tarih Ve Kültür Kongresi, 1016 Mayıs, Priştine, Kosova

Veland Ramadani, Gadaf Rexhepi, Shqipe Gerguri-Rashiti, Sadudin Ibraimi And Leo-Paul Dana;(2014), Ethnic Entrepreneurship İn Macedonia: The Case Of Albanian Entrepreneurs .

Yurtseven, H.Rıdvan; (2007), Girişimcilik (Küçük Bir İşletme Kurmak Ve Yönetmek), Detay Yayıncılık, Ankara.

Zlotnik, Hania.; (1998), “International Migration 1965-96: An Overview,” Population And Development Review

Wong, P, Ho, Y. And Autio, E; (2005), “Entrepreneurship, Innovation And Economic Growth: Evidence From Gem Data”, Small Business Economics, 24, 335-350.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Wahlbeck, Ö; (2007). “Work in the kebab economy: A study of the ethnic economy of Turkish immigrants in Finland”, SAGE Publications. 7(4): 543-563.

Demir U. (2008), “Girişimcilik ve Küçük İşletme Yöneticiliği”, 2. Baskı, Serpil Döm, Detay Yayıncılık



**US MONETARY POLICY, GLOBAL RISK APPETITE AND CAPITAL FLOWS TO
TURKEY**

Osman Berke DUVAN*

Burçhan SAKARYA**

ABSTRACT

Since global financial crisis (GFC) of 2008, the lax monetary policy of advanced economies established the grounds of international capital flows. This so called easy money had also supported a synchronized economic and financial cycle for emerging market economies (EMEs). While doing so, as literature also indicates (Furceri and et al 2011a, b), these flows brought a threat of overheating in the host economies, accumulating financial risks. Thus, as the Fed initiated quantitative tightening (QT) in mid-2013, global capital flows started to contract. During this episode, overall risk appetite towards emerging markets have been weakening, even more for some other EMEs. In this study, we tried to shed light on whether there is a co-movement between the U.S. monetary policy, global risk appetite and financial flows to Turkey, and what factors drove Turkey away from other EMEs, causing the de-synchronization. Data and results indicates that Turkish macroeconomic framework loosing track since 2013 due to factors of both economic and political nature contributed the latest episode of turbulence on top of global EM sell off.

Keywords: Capital Flows, Emerging Markets

JEL Codes: F32, E44.

1. INTRODUCTION

Net capital flows toward the emerging market economies have been strongly correlated with changes in the global financing conditions, showing dramatic surges during periods of relatively low global interest rates and greater risk appetite and falling afterwards. As a matter of fact, the lax monetary policy of advanced economies laid the grounds for the surge in international capital flows to the emerging market economies (EMEs) since the global financial crisis (GFC) of 2008. This so called 'easy money' printed at the heart of the global financial system had also supported a synchronized economic and financial cycle for EMEs (Rey, 2013).

Though emerging economies benefited from easy money in the finance of economic growth, magnitude and composition of capital flows also brought about a threat of overheating in the host

* Expert, PhD, Ministry of Trade, Ankara, Turkey,berkeduvan@yahoo.com

** Expert, Assoc. Prof. Dr., TR Presidency PSB, Ankara, Turkey,bsakarya@gmail.com

*ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES*

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

economies and accumulated financial risks (Furceri et al, 2011). Those risks made some emerging economies more fragile to changes in global liquidity conditions compared to the others.

As the FED initiated quantitative tightening (QT) in mid-2013, global capital flows started to contract. Due to changing global financing conditions initiated by the FED, the volatility in emerging markets increased. The most recent emerging market selloff was experienced in the second half of 2018. As it happened in previous selloffs, some EMEs were much shaken in the last turbulence regarding to the peers. Turkey and Argentina were in the forefront in the last desynchronization.

This brings a legitimate question into mind as to why especially some emerging markets have been severely affected by this type of market incidents since the announcement of tapering off in U.S. economy. What went wrong for such countries just after the decision on the FED's clawing back the easier monetary policy stance?

To answer those questions, we specifically focused on Turkish economy and tried to shed light on why Turkey has started to decouple from her peers since the waning of global risk appetite. The question also rests on what the peers did and Turkey did not in the episode of both capital flow surge and in the aftermath.

The rest of the paper is organized as follows: As the background, first chapter summarizes the evolution of net international capital flows to Turkey before and after the decision of QT. Second chapter explains the vulnerabilities that accumulated in Turkish economy just after the global financial crisis. Chapter three gives a brief picture about what happened and how Turkey desynchronized in the last market selloff in 2018. Chapter four provides an analytical perspective on the story of desynchronization. Finally chapter five concludes.

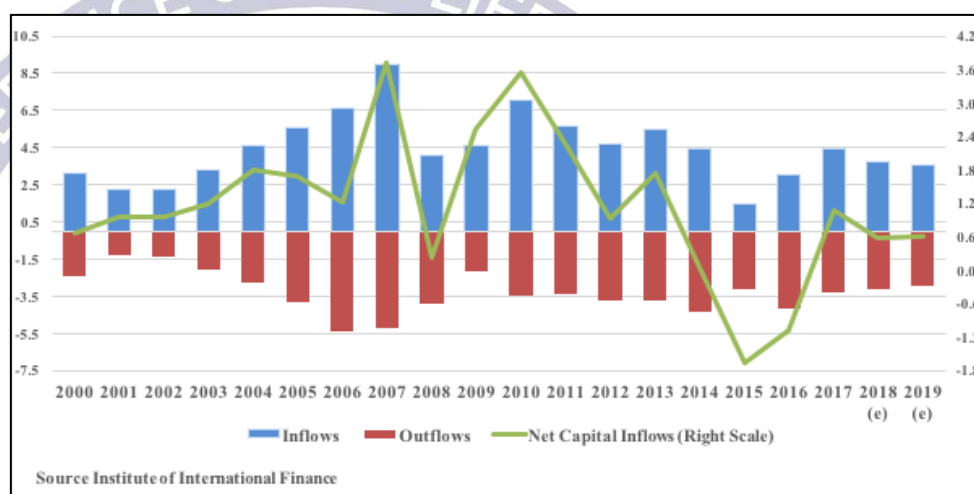
2. CAPITAL FLOWS TO TURKEY BEFORE AND AFTER THE GFC

In the economic literature, the drivers of capital flows are divided into what is known as “push” and “pull” factors. The push factors are external conditions that underpin the supply of global liquidity, and include variables like global risk aversion, global commodity prices, US economic growth, and U.S. interest rates. On the other hand, pull factors are the domestic characteristics that influence risks and returns to investors, and include domestic macroeconomic fundamentals, domestic policies, market imperfections, and domestic cyclical components like the economic growth and the interest rate in the country (Hannan, 2018).

In almost last two decades, net international capital flows to the EMEs have been on an unprecedented roller-coaster ride. In this period, the emerging markets have experienced two different episodes of surges in capital inflows. The first of these started in 2003 and ebbed in 2008 in the wake of GFC. The second one commenced in the period 2009-2010 just after the quantitative easing (QE)

operations and continued with a fading momentum up to 2013³⁷. In May 2013, with the declaration of monetary policy normalization aspiration by the Fed chairman, market sentiment started to change and in 2014 capital outflows begun to surpass capital inflows in the emerging economies. In the last month of 2015, the Fed initiated interest rate hikes and the said decision also put pressure on capital flows to emerging markets. Though in 2017 and 2018, the net capital inflow passed to positive territory it is still well-below the post crisis period (for another perspective on emerging market capital flows and U.S. Monetary Policy nexus see Clark et al, 2016).

Chart 1. Capital Flows to EMEs (% of GDP)



In line with the global conditions, Turkey also experienced two major capital inflow surges in 2003-2008 and in 2010-2013 respectively (see Chart 2)³⁸. The first capital inflow surge just came after having Turkish economy hit rock bottom in 2001 crisis. The first surge coincided with the IMF led economic programme and helped Turkey to overcome the aftermaths of its own financial crisis. In the post 2001 crisis period, Turkey achieved high growth rates, bringing inflation to single digits and alleviating higher public debt burden. But, at the same time, Turkey started to lose competitiveness, face unsustainable current account deficits and register poor employment performance in the first capital surge episode.

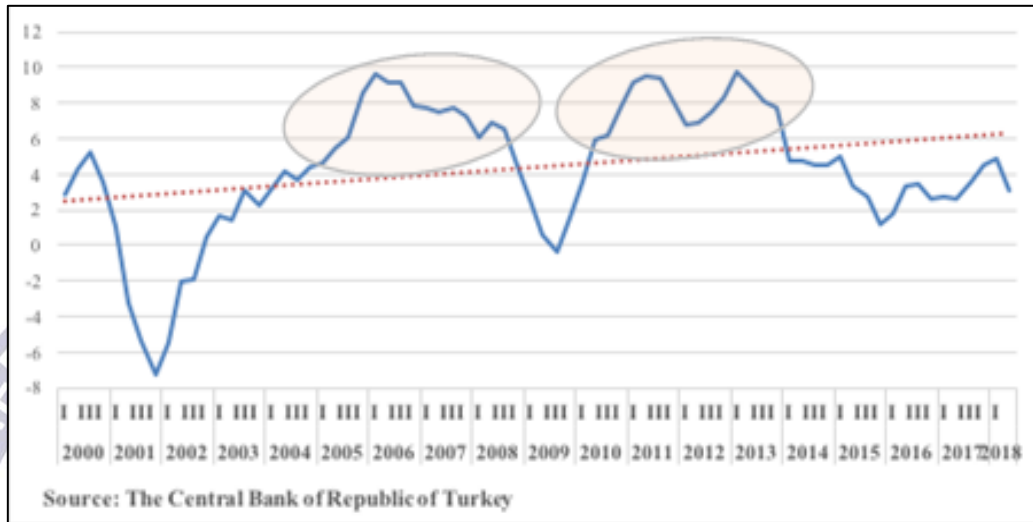
GFC came against this background and Turkish economy hit another rock bottom in 2009 where central banks in the advanced economies emerged as the helping hand, this time. This second surge initially helped Turkey to escape easily from the bust cycle and the negative outcomes of GFC. As it is

³⁷ FED initiated its QE operations in late November 2008, while the second round of QE was announced in November 2010, and finally the third round of QE was announced on 13 September 2012.

³⁸ Our measure for quarterly net private capital flows is the sum of net FDI, net portfolio inflows and net other inflows to Turkey from BOP data of the CBRT. To compute the ratio of net private capital inflows to GDP, both quarterly GDP and net capital inflows data are annualized on a rolling basis.

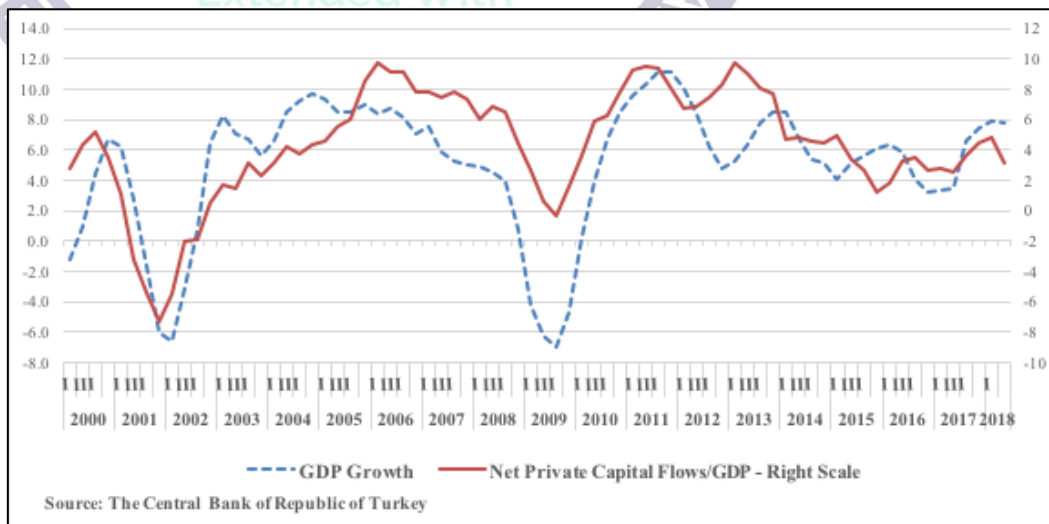
discussed in next chapter the new capital inflow surge and its aftermath brought other problems and led the Turkish economy to accumulate serious vulnerabilities.

Chart 2. Net Private Capital Flows / GDP (%)



The data clearly show that the growth performance of Turkish economy relies heavily on net capital inflows (see Chart 3). This evidence carried the quality and sustainability of growth performance of Turkish economy to a questionable platform while heavy reliance on foreign funding exposed Turkish economy to the risks on grounds of vulnerability to the global liquidity conditions and degree of risk appetite of the international capital movements.

Chart 3. GDP Growth and Net Private Capital Flows/GDP (%)



In the first surge episode (2003-2007) Turkey's average annual growth rate was almost in line with the peer countries while it was well-above its historical averages. On the contrary, in the second surge episode (2010-2013), Turkey's growth performance was remarkably higher than other emerging

**ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance
& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES**

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

economies (see Table 1). Both in emerging economies and in Turkey the volatility of growth rate appeared higher in the second surge episode.

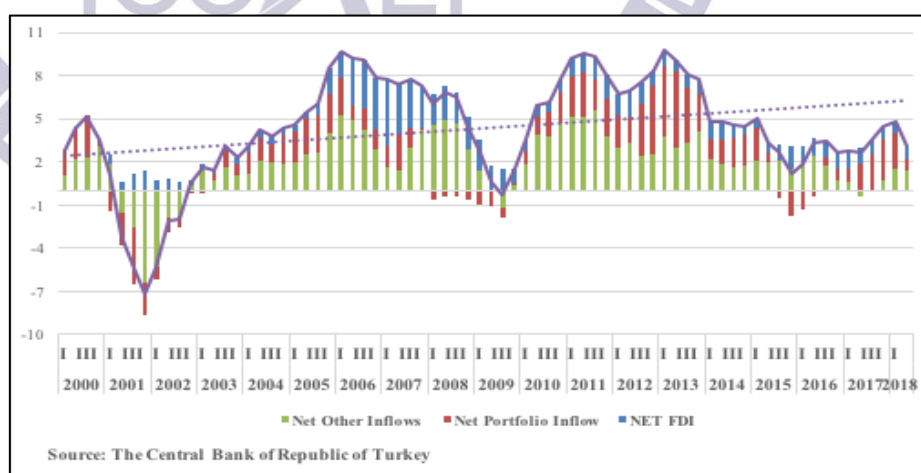
Table 1. Growth Performance of Emerging Economies in the Surge Episodes

| | 2003-2007 (1 st Surge Episode) | | 2010-2013 (2 nd Surge Episode) | |
|--------------------|---|----------------|---|----------------|
| | Growth Rate | Std. Deviation | Growth Rate | Std. Deviation |
| Emerging Economies | 7.61 | 0.89 | 6.29 | 1.28 |
| Turkey | 7.27 | 2.03 | 8.20 | 2.60 |

Source: IMF WEO Database *The list of emerging economies is based on the classification of Institution of International Finance. 25 emerging economies are included in the computation of average growth rate. Growth rate is GDP (PPP adjusted) weighted average of EMEs' year-on-year growth.*

Another important issue that might worth to mention is that in terms of composition of capital inflows, there is a significant difference between the two surge episodes. In the first episode, mainly due to enormous number of privatizations in Turkey, net FDI had remarkable share in the capital inflows surge. On the contrary, after GFC the net FDI had a small share in the capital inflows and thus the capital inflows mainly consisted of net portfolio and net other inflows (debt creating inflows). In the second episode increased reliance on debt creating and speculative inflows made Turkish economy much sensitive to global risk appetite and international liquidity conditions (for further details on transmission of capital flows to systemic risks in Turkey see IMF, 2017).

Chart 4. The Composition of Capital Flows (% of GDP)

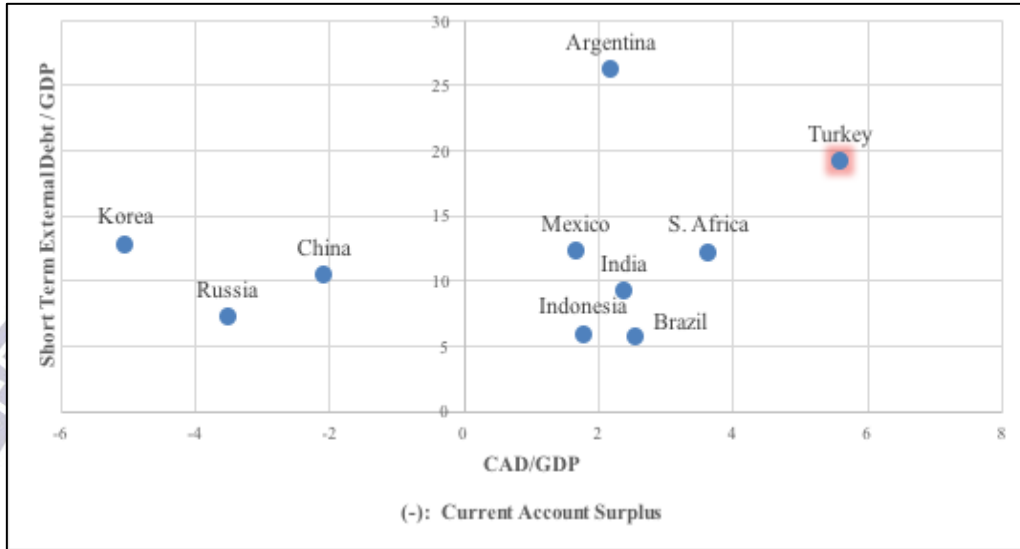


3. TURKISH ECONOMY IN POST-GFC PERIOD

Though Turkey had a strong growth performance in the post-GFC period, domestic demand driven growth was accompanied by the external and internal imbalances. The overheated economy with

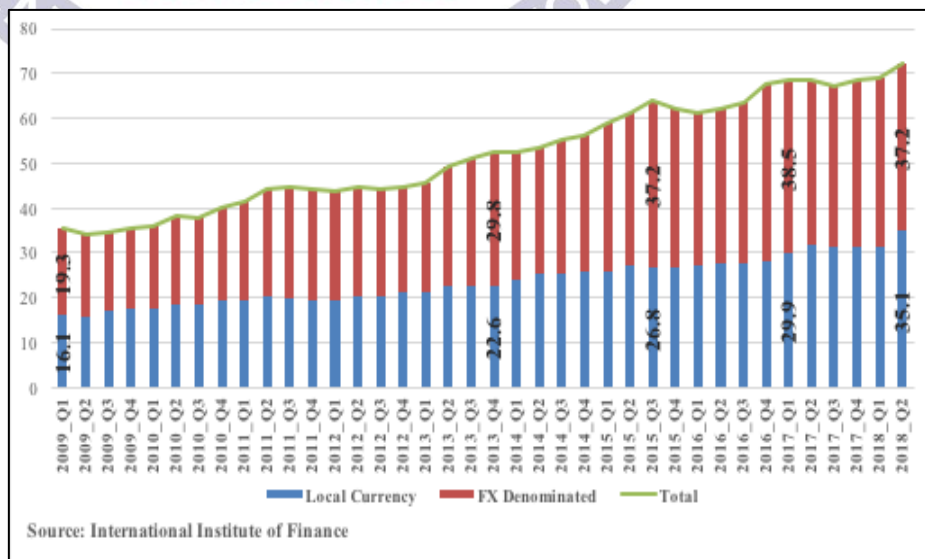
widening current account deficit, growing external financing needs, rising private domestic and external indebtedness altogether jeopardized the sustainability of growth in Turkey.

Chart 5. Current Account Deficit and Short Term External Debt (2010-2018 Avg.)



In the wake of GFC, one of the important policy mismanagements was that of relaxing the prudential rules which used to serve to provide buffer against external shocks. In the mid 2009, Turkey began relaxing her macro prudential regulations such as allowing non-FX earning corporates to borrow FX denominated loans. This triggered a shift in the composition of loans used by non-financial corporate in favor of FX denominated loans and made the Turkish non-financial corporates become vulnerable to sudden FX movements (see Chart 6).

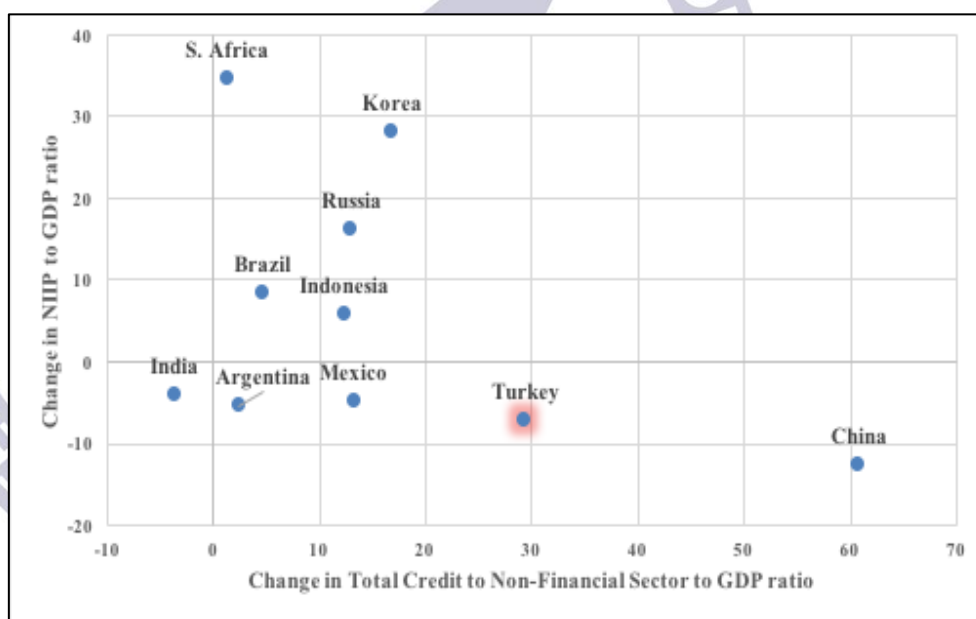
Chart 6. Non-Financial Corporate Debt(%of GDP)



The growth in indebtedness was remarkably high, pushing Turkey in the top rank of countries by the post-crisis growth of private indebtedness. The rapid credit growth was in part financed by external borrowing, resulting in a remarkable deterioration of Turkey's Net International Investment Position (NIIP) (see Chart 7).

But all such increasing risks were easily affordable when global risk appetite was high, “push factors” were leading and liquidity was abundant. “As far as current account deficit is financed, it doesn't matter” was the main motto during the favorable global liquidity conditions. But just after the announcement of QT in May 2013, “pull factors” started to dominate and the idiosyncratic risks of Turkish economy became observable. Specifically, the high and persistent current account deficit and huge external financing needs made Turkey one of the vulnerable economies against the changing global liquidity conditions.

Chart 7. Changes in Total Credit to Non-Financial Sector and NIIP (2017-2010, % of GDP)



Tightening global conditions became more evident after 2016, while Turkey was dealing with some political uncertainties such as the failed coup d'état in mid-2016 and the developments afterwards. To tackle with the negative effects of those uncertainties on growth performance of the economy, Turkey introduced some measures such as extending the role of Credit Guarantee Schemes in domestic credit markets and easing the fiscal stance. As a result, these measures also put extra pressure on external and internal imbalances of the economy and increased Turkey's potential exposure to changing global conditions.

Table 2. Macroeconomic Performance of Some Emerging Countries

| | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018E | 2013-2017 Avg. |
|--|------|------|------|------|------|-------|----------------|
|--|------|------|------|------|------|-------|----------------|

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

| | | | | | | | | |
|---------------------------------------|--------|------|------|------|------|------|------|------|
| Real GDP (YoY, %) | BRICS | 5.9 | 5.4 | 5.0 | 5.2 | 5.7 | 5.7 | 5.4 |
| | Turkey | 8.9 | 5.0 | 5.9 | 3.2 | 7.4 | 3.8 | 6.1 |
| Current Account Balance (% of GDP) | BRICS | 0.2 | 0.9 | 1.7 | 1.1 | 0.8 | 1.0 | 1.0 |
| | Turkey | -6.7 | -4.7 | -3.7 | -3.8 | -5.2 | -4.7 | -4.8 |
| Budget Balance (% of GDP) | BRICS | -2.3 | -2.3 | -3.9 | -4.4 | -4.2 | -3.5 | -3.4 |
| | Turkey | -1.0 | -1.1 | -1.0 | -1.1 | -1.5 | -1.9 | -1.3 |
| Short Term Interest Rates | BRICS | 6.7 | 8.1 | 6.3 | 6.1 | 5.2 | 5.2 | 6.3 |
| | Turkey | 4.5 | 8.3 | 7.5 | 8.0 | 8.0 | 24.2 | 10.1 |

Source: Bloomberg and NEP**4. THE EMERGING MARKET SELL OFF AND DE-SYNCHRONIZATION OF TURKEY**

In 2018, boosting of interest rates in the US, raising trade tensions between the US and China and heightened political risks around the world increased pressures markedly on EMEs. Combining unfavorable global background, Turkey's own economic vulnerabilities and political uncertainties, due to the general election held in mid-2018 and growing diplomatic tension with the US, increased stress over Turkish Lira even further. In August 2018, Turkish Lira crashed to record lows against the US Dollar and the chaos in the markets triggered an emerging market sell off. Turkey was at the center of this market turmoil and while Turkish Lira plunging, the interest rates and Credit Default Swaps (CDS) of Turkey raised sharply.

After initial shock, some measures were undertaken by policy makers to calm market's intensified tension. But one of the substantial steps was taken by the CBRT, almost a month later from the market turmoil. The CBRT raised its benchmark interest rate by 625 basis point to 24 % on September 13. This rate hike was well above market expectations and positively affected the market sentiments. Another market relieving event realized in October, the diplomatic relations between the US and Turkey started to normalize and this also provided a positive outlook to the markets. Though Turkish Lira regained its loss against the US dollar to a certain extent, it is still well above the level before the market sell off. Thus, Turkish Lira is still one of the worst performers within the emerging market universe since the beginning of 2018. Not only FX rate but also Turkey's CDS are still above the pre-market sell off period level.

The asymmetry between the level of pre-selloff and after selloff FX rates theoretically is not odd. Since the elegant paper of Dornbusch (1976) the mechanism for exchange rate overshooting has been very well known. The overshooting model argues that FX rate will temporarily overreact to changes in policy shocks which creates equilibrium in the short run. And, as the other prices gradually respond and adjust to the FX market, the FX markets moderate their reactions and provide long run equilibrium. Thus, there will be more volatility in FX rates due to overshooting and subsequent corrections would be expected.

To understand Turkey's desynchronization from her peers and whether this desynchronization does effect Turkey's CDS (risk premiums), we tried to conduct an empirical analysis in the next chapter.

5.MODEL SPECIFICATION AND RESULTS

A credit default swap (CDS) is a financial swap agreement between two parties. The main context is as the name states a swap of risk i.e. a purchase of protection against an event of a default. When this default is associated with a sovereign state, this CDS premium (spread) is assessed as the risk of a sovereign country. Thus through bond market this CDS spread is widely used as an *ad hoc* risk indicator especially for emerging market economies.

In this study, we have initially analyzed the behaviour of CDS spreads for Turkey, against Turkish decoupling associated with the foreign exchange market for 2012-2018 period. This way rather than exploring determinants of CDS spreads, we are pointing out the cost of decoupling from other EMEs since 2013. Likewise the second model is to capture the cost of increase in CDS spreads on carry trade returns, by asking that do possible carry trade returns, interest rate differentials and exchange rate expectations, effect CDS spreads.

Moreover, considering risk perception and pricing being asymmetric, we have utilized nonlinear autoregressive distributed lags (NARDL) model of Shin et al. (2011). This approach is an extension of the autoregressive distributed lags (ARDL) bounds testing approach of Pesaran et al. (2001). NARDL is especially useful in capturing and estimating asymmetric long run as well as short run coefficients in a cointegration framework. Moreover the NARDL models permit testing for hidden cointegration and can be applied whether the times series is I(0) or I(1) (Guesmi et.al., 2018)

Briefly, the NARDL estimation has two main stages different than a standart ARDL model. First of one needs to run a unit root test to check the order of integration of the variables involved to verify that none is I(2). Such evidence results invalid F-statistics for testing cointegration. The other stage is identifying positive and negative changes as separate indicators. While some econometric software packages do that for you with built in NARDL procedures, one can employ this method and then estimate an ARDL model for these variables.

The first model specification is follows:

$$CDS_t = \alpha + \sum_{i=1}^{n1} \beta_0 CDS_{t-i} + \sum_{i=1}^{n2} \beta_1 EMEXCOR_{t-i}^+ + \sum_{i=1}^{n3} \beta_1 EMECOR_{t-i}^- + u_t. \text{ (eq1)}$$

Where, CDS is the Turkish sovereign CDS spread, and the EMEXCOR is the 40 day rolling correlation of TL against MSCI emerging market economies foreign exchange index. Following the unit root tests, as no variable is I(2) tested for various unit root statistics, the preliminary results are given below table. Also, lag lengths are determined by AIC.

Table 3. NARDL Estimation Output Model-1

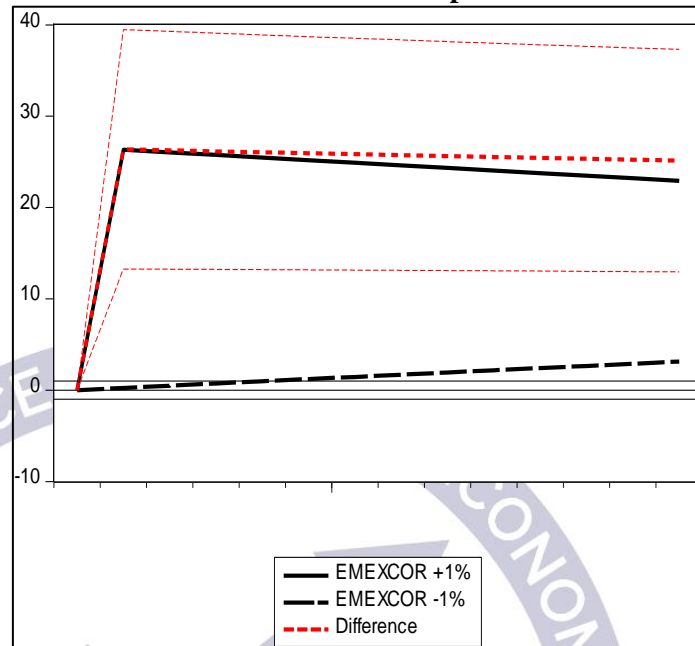
Dependent Variable: CDS
 Method: ARDL
 Sample (adjusted): 12/03/2012 11/12/2018
 Included observations: 1551 after adjustments
 Maximum dependent lags: 4 (Automatic selection)
 Model selection method: Akaike info criterion (AIC)
 Dynamic regressors (4 lags, automatic): EMEXCOR_POS EMEXCOR_NEG
 Fixed regressors: C
 Number of models evaluated: 100
 Selected Model: ARDL(2, 3, 2)

| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Statistic | Prob.* |
|--------------------|-------------|-----------------------|-------------|----------|
| CDS(-1) | 1.182853 | 0.024948 | 47.41289 | 0.0000 |
| CDS(-2) | -0.191915 | 0.024998 | -7.677198 | 0.0000 |
| EMEXCOR_POS | 24.05373 | 8.147757 | 2.952191 | 0.0032 |
| EMEXCOR_POS(-1) | 24.70207 | 11.58780 | 2.131730 | 0.0332 |
| EMEXCOR_POS(-2) | -59.29551 | 11.34258 | -5.227691 | 0.0000 |
| EMEXCOR_POS(-3) | 11.46075 | 7.950808 | 1.441457 | 0.1497 |
| EMEXCOR_NEG | -3.119652 | 7.855864 | -0.397111 | 0.6913 |
| EMEXCOR_NEG(-1) | -19.75402 | 11.49472 | -1.718530 | 0.0859 |
| EMEXCOR_NEG(-2) | 23.69993 | 7.956462 | 2.978702 | 0.0029 |
| C | 0.423777 | 0.680509 | 0.622735 | 0.5336 |
| R-squared | 0.989585 | Mean dependent var | | 225.1732 |
| Adjusted R-squared | 0.989525 | S.D. dependent var | | 67.24198 |
| S.E. of regression | 6.882207 | Akaike info criterion | | 6.702182 |
| Sum squared resid | 72989.12 | Schwarz criterion | | 6.736655 |
| Log likelihood | -5187.542 | Hannan-Quinn criter. | | 6.715003 |
| F-statistic | 16269.26 | Durbin-Watson stat | | 1.991091 |
| Prob(F-statistic) | 0.000000 | | | |

*Note: p-values and any subsequent tests do not account for model selection.

The initial concern of this analysis is to establish the existence of asymmetry in the movement of CDS. One could apply (G)ARCH type estimations to test for asymmetry while NARDL allows for cointegration and causality between variables. In this case we can clearly observe and identify a non-linear behavior of changes in CDS spread, associated with de-synchronization of domestic currency with other (peer group) EME currencies. In case of de-synchronization, CDS spreads tend to widen more, while convergence to peer group does not help narrowing the changes in spreads as much. This can be also seen in below chart of NARDL multipliers.

Chart 8. NARDL Multiplier Plots for Model-2



The second model specification is follows:

$$CDS_t = \alpha + \sum_{i=1}^{n_1} \beta_0 CDS_{t-i} + \sum_{i=1}^{n_2} \beta_1 VACT_{t-i}^+ + \sum_{i=1}^{n_3} \beta_1 VACT_{t-i}^- + u_t. \text{ (eq2)}$$

Where, CDS is the Turkish sovereign CDS spread, and the VACT is the volatility adjusted carry trade return for TL against USD at monthly maturity. Following the unit root tests, as no variable is I(2) tested for various unit root statistics, the preliminary results are given below table.

Table 4. NARDL Estimation Output Model-2

| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Statistic | Prob.* |
|--------------|-------------|------------|-------------|--------|
| CDS(-1) | 1.145176 | 0.024417 | 46.90128 | 0.0000 |
| CDS(-2) | -0.156967 | 0.024357 | -6.444512 | 0.0000 |
| VACT_POS | -23.16491 | 9.461534 | -2.448325 | 0.0145 |
| VACT_POS(-1) | 14.75625 | 14.19204 | 1.039755 | 0.2986 |
| VACT_POS(-2) | 25.32590 | 13.72462 | 1.845290 | 0.0652 |
| VACT_POS(-3) | -21.33962 | 9.012216 | -2.367855 | 0.0180 |
| VACT_NEG | -31.81385 | 7.773525 | -4.092589 | 0.0000 |
| VACT_NEG(-1) | -41.33034 | 11.97391 | -3.451700 | 0.0006 |
| VACT_NEG(-2) | 68.61058 | 7.819296 | 8.774522 | 0.0000 |
| C | -0.067846 | 0.629490 | -0.107779 | 0.9142 |

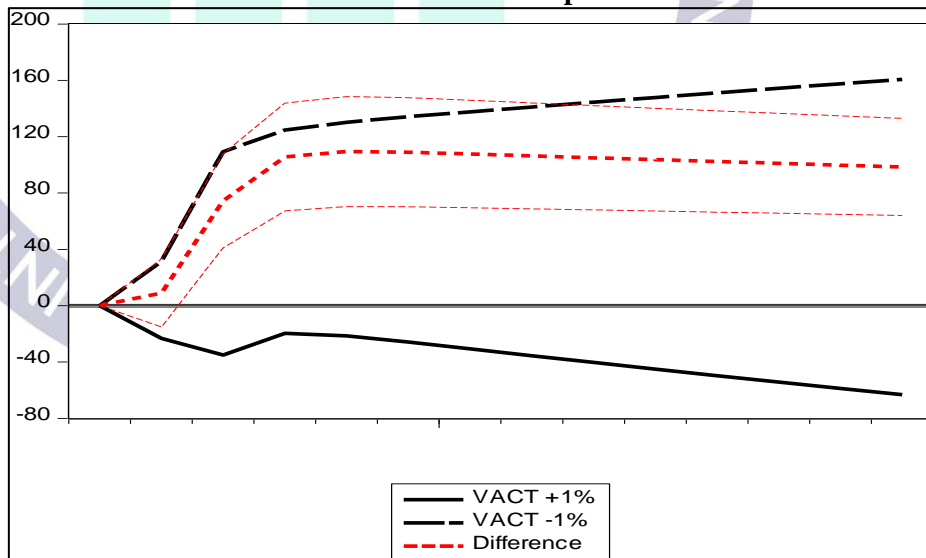
Table 4. NARDL Estimation Output Model-2 (Cont.)

| | | | |
|--------------------|-----------|-----------------------|----------|
| R-squared | 0.990313 | Mean dependent var | 225.1732 |
| Adjusted R-squared | 0.990257 | S.D. dependent var | 67.24198 |
| S.E. of regression | 6.637307 | Akaike info criterion | 6.629716 |
| Sum squared resid | 67886.97 | Schwarz criterion | 6.664189 |
| Log likelihood | -5131.345 | Hannan-Quinn criter. | 6.642537 |
| F-statistic | 17504.87 | Durbin-Watson stat | 1.982370 |
| Prob(F-statistic) | 0.000000 | | |

*Note: p-values and any subsequent tests do not account for model selection.

In the second model we can observe and identify a non-linear behavior of changes in CDS spread, associated with volatility adjusted (notional) carry trade returns. The idea is to capture the asymmetry of *ad hoc* risk-return seeking behavior of short term capital flows. Even with volatility adjusted series i.e. counting out exchange rate uncertainties, with higher possible carry trade returns, comes higher changes in CDS spreads. However unlike model 1, this relation seems to be considerably symmetric. This is mainly attributable to a short term consistency of uncovered interest rate parity for this maturity (1 month in this case).

Chart 9. NARDL Multiplier Plots for Model-2



6.FINAL REMARKS

Emerging market economies benefited from surges of global liquidity since mid-1990s. However, especially since the global financial crisis (GFC) of 2008, the lax monetary policy of advanced economies the volume of global liquidity reached an immense size, defining the grounds of international capital flows. This so called easy money had also supported a synchronized economic and financial cycle for emerging market economies (EMEs).

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

However, this blessing came with a curse of overheating with domestic economies and fear of exit, as at some point in time advanced economies were/are expected to return to a “normal” state of monetary policy.

Especially with the “tapering” announcement of the FED in May 2013, many global liquidity induced capital flow receiving emerging market economies, tried to prepare themselves, considering their own domestic economic and financial market outlook via use of sound macro policies coupled with prudent financial policies (such as use of macro prudential policies) to make way for a softer landing. Some emerging market economies on the other hand could not follow this path due to their own economic, political and external conditions, such as Argentina and Turkey.

Moreover, changing global economic outlook and increased political uncertainties in a wide range of emerging market economies, augmented with trade war rhetoric ignited a sell off of emerging market assets. This episode gained momentum during late summer 2018, leading a severe exchange rate depreciation in Argentina and Turkey. This study shows that these are the end results of these two economies post 2013 economic performance, which heightened their external fragility. Additionally, a brief NARDL estimation indicates that in case of such de-synchronization, CDS spreads tend to widen more, while convergence to peer group does not help narrowing the changes in spreads as much. Even this mere finding shows that for EMEs cost of funding and credibility can topple rather quickly while restoring credibility is significantly harder and takes much longer time. Thus, once attaining considerable achievements in economic performance and soundness, especially EMEs should focus on protecting these and policy makes should withstand cyclical and political pressures. This would benefit their economic performance and/or at least their cost of borrowing in the medium term as further monetary tightening is expected from advanced economies.

REFERENCES

CBRT Electronic Data Delivery System

Clark, J., Nathan C., Coulibaly B., Kamin S. (2016) Emerging Market Capital Flows and U.S. Monetary Policy, Board of Governors of the Federal Reserve System, International Financial Discussion Paper Note

Dornbusch, R. (1976), Expectations and Exchange Rate Dynamics, *Journal of Political Economy*, 84 (6): 1161-1176

Furceri, D., Guichard, S., Rusticelli, E. (2011) Episodes of Large Capital Inflows and the Likelihood of Banking and Currency Crises and Sudden Stops, OECD Economics Department Working Papers, No: 865, <http://dx.doi.org/10.1787/5kgc9kpkslvk-en>

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

- Guesmi, K., Dhaoui A, Goutte, S. Abid I. (2018) On the determinants of industry-CDS index spreads: Evidence from a nonlinear setting, *Journal of International Financial Markets, Institutions & Money*. <https://doi.org/10.1016/j.intfin.2018.01.005>
- Hannan, S.A. (2018) Revisiting the Determinants of Capital Flows to Emerging Markets – A Survey of the Evolving Literature, IMF Working Paper, WP/18/214
- IMF (2017), Increasing Resilience to Large and Volatile Capital Flows: The Role of Macroprudential Policies-Case Studies, IMF Policy Paper
- IMF World Economic Outlook Database.
- Pesaran, M., Shin, Y., & Smith, R. (2001). Bounds testing approaches to the analysis of level relationships. *Journal of Applied Econometrics*, 16: 289–326. [http://dx.doi.org/10.1002/\(ISSN\)1099-1255](http://dx.doi.org/10.1002/(ISSN)1099-1255)
- Rey, H. (2013). Dilemma not Trilemma: The Global Financial Cycle and Monetary Policy Independence, Federal Reserve Bank of Kansas City Global Dimensions of Unconventional Monetary Policy Economic Symposium Papers, 285-333
- Shin, Y., Yu, B., and Greenwood-Nimmo, M. (2011). Modelling Asymmetric Cointegration and Dynamic Multiplier in a Nonlinear ARDL Framework. New York, NY: Mimeo.
- Bloomberg



**OSMANLI İMPARATORLUĞU'NUN DENİZ GÜCÜNÜN VE DENİZCİLİK
POLİTİKALARININ BEŞ ÖNEMLİ SAVAŞ ÜZERİNDEN ANALİZİ¹**

Dr. Levent BİLGİLİ*

ÖZET

Osmanlı İmparatorluğu, kurulduğu tarihten yükseliş döneminin ortalarına dek bir kara gücü olarak gelişmiştir. Devletin deniz gücüne gereken önemi vermesi ancak Kızıldeniz vasıtasıyla Hint Okyanusu'na açılmasıyla mümkün olmuş, yine bu dönemde Mısır'ın fethiyle gelen büyük zenginlikler sayesinde güçlü bir donanma oluşturulması için gereken güç elde edilebilmiştir. Devletin büyük bir cihan imparatorluğu olma hedefi ve arzusu da donanmanın güçlendirilmesi yolunda önemli bir gelişme olarak kabul edilebilir.

Ege Denizi ve Karadeniz'in Osmanlı gölü haline getirilmesiyle başlayan süreç, Preveze Deniz Savaşı'yla Doğu Akdeniz hakimiyetinin tamamen ele geçirilmesiyle zirveye ulaşmıştır. Bu zaferden çok kısa süre sonra gerçekleşen İnebahtı mağlubiyeti, devletin gücüyle birlikte itibarına ağır bir darbe indirmiştir. Bu mağlubiyete rağmen Osmanlı deniz gücü, Akdeniz'in en önemli askeri unsurlarından birisi olarak devam etmiştir. 1770'teki Çeşme, 1827'deki Navarin ve 1853'teki Sinop baskınları, yüz yıldan kısa bir süre içinde bir zamanların görkemli donanmasını bölgesel faaliyetlere mahkum orta ölçekli bir güce düşürmüştür ve Osmanlı deniz gücünün Avrupa donanmaları karşısındaki yetersizliğini gözler önüne sererek devletin bu alanda yenilikler yapmaya odaklanmasını sağlamıştır.

Bu çalışmada, devletin denizcilik politikasını belirlemesi açısından önem arz eden Preveze, İnebahtı, Çeşme, Navarin ve Sinop savaşlarının nedenleri ve sonuçları incelenmiş olup bu savaşlardan önce ve sonraki dönemlerde Osmanlı İmparatorluğu'nun denizcilik politikalarının gelişimi üzerinden savaşların etkileri araştırılmıştır.

Anahtar Kelimeler: *Osmanlı İmparatorluğu, Osmanlı Donanması, Deniz Savaşları, Osmanlı Denizcilik Politikası*

¹ Bu çalışma Bandırma Onyediy Eylül Üniversitesi Bilimsel Araştırma Projeleri Koordinatörlüğü tarafından BAP-18-DF-1009-124 kodlu proje ile desteklenmiştir.

*Bandırma Onyediy Eylül Üniversitesi, Denizcilik Fakültesi, Gemi İnşaatı ve Gemi Makineleri Mühendisliği Bölümü, Merkez Yerleşke, Balıkesir/Türkiye, e-mail: lbilgili@bandirma.edu.tr, Tel: +90 266 717 01 17/2006

1. GİRİŞ

1.1. Türk Denizcilik Tarihine Kısa Bir Bakış

Türk Deniz Kuvvetleri'nin kuruluş tarihi İzmir'in 1081 yılında Çaka Bey tarafından fethedilip bir donanma kurulmasıyla başlatılır. Bu tarih, ironik bir biçimde Türk denizciliğinin de başladığı tarih olarak kabul edilir. Halbuki Türklerin ya da Türkler tarafından yönetilen kavimlerin zaman zaman deniz gücüne saldırı veya savunma amaçlı başvurduğu durumlar da mevcuttur. Dolayısıyla 1081 yılının Türk denizciliği için bir milat olarak kabul edilmesinin nedeni, denizcilikten stratejik olarak ilk kez faydalanılmaya başlanmasının tarihidir.

Su kavramının Türk mitolojisinde önemli bir yeri olmasına rağmen, erken dönemlerden beri özellikle coğrafi şartlardan ötürü karasal devlet anlayışına sahip olan Türklerin denize açılması ancak Anadolu'nun fethinden sonra gerçekleşmiş ve bu erken denizcilik döneminde önemli başarılar elde edilse de uzun bir süre kısıtlı düzeyde kalmıştır. Erken dönemde Bizans donanmasına karşı alınan zaferlerden ve Orta ve Kuzey Ege'nin Çaka Bey'in denetimine girmesinin ardından ilki 1096 yılında başlatılan Haçlı Seferleri sebebiyle Türk denizciliği büyük darbe almış ve Anadolu'nun iç bölgelerinin korunması maksadıyla üretilen politikalar sebebiyle uzun bir süre ikinci planda kalmıştır. Türk denizciliğinin yeniden yükselmesi ancak Anadolu Selçuklu Devleti'nin bölgede güçlenmesi ve 1207 yılındaki Antalya'nın fethi ve 1228 yılında Alanya tersanesinin kurulması ile sağlanabilmiştir. Anadolu Selçuklu Devleti'nin de zayıflayıp parçalanmasından sonra Osmanlı Devleti'nin tarih sahnesine çıkmasıyla Türk denizciliği de yeni bir döneme girmiştir.

Kuruluş devrinde kara gücüne destek vermek amacıyla kullanılan donanma, özellikle 16. yüzyılda başlı başına bir güce dönüşmüş ve İngiliz amiral Sir Adolphus Slade'in ifadelerine göre 'Osmanlı donanması imparatorluğun sağ koludur ve Kaptan Paşa imparatorluktaki üçüncü en büyük rütbeye sahip kişidir. İnebahtı, Eğriboz, Gelibolu, Biga, Kocaeli ve Sığla Sancakları'nın gelirleri donanmaya tahsil edilmiştir' (Badem, 2012). Bu dönemde Kuzey Afrika'nın deniz yoluyla fethinin gerçekleşmesi de donanmanın gücünü ortaya koymaktadır.

Bu güce ve ihtişama rağmen, 7 Ekim 1571 yılındaki İnebahtı Deniz Muharebesi, donanmanın ve devletin aldığı ilk büyük yenilgi olarak da kayıtlara geçmiştir. Mağlubiyete rağmen gücünü uzun süre muhafaza eden donanma ve devlet, 5-7 Temmuz 1770 yılında yaşanan Çeşme Deniz Muharabesi ile artık dağılma sürecine girdiğinin sinyallerini vermiştir. 20 Ekim 1827'de gerçekleşen Navarin Deniz Muharebesi ve 30 Kasım 1853'te gerçekleşen Sinop Baskını da devleti zayıf düşürmüştür. Bununla birlikte bu üç mağlubiyet, devletin denizcilik ve hatta genel yönetim politikaları üzerinde büyük etkiler bırakmıştır.

Bu çalışmada, bahsedilen bu savaşların neden ve sonuçları incelenecek ve Osmanlı İmparatorluğu'nun denizcilik tarihinin ve politikalarının gelişimi bu beş önemli deniz savaşı üzerinden analiz edilecektir.

1.2 Osmanlı İmparatorluğu'nun Denizcilik Anlayışı

Osmanlı İmparatorluğu'nun denizle ilk teması, 1321 yılında gerçekleşen Mudanya'nın fethiyle gerçekleşmiştir. Bu erken dönemdeki denizcilik faaliyetleri, devletin ilk kuruluş devrindeki esas hedefi olan Bursa'nın, Bizans'ın Marmara Denizi yoluyla göndereceği yardımlara ulaşmasını engellemeye yöneliktir. Güney Marmara'nın fethinden sonra Osmanlılar'ın denizlerdeki ilgisi Ege Adaları'na ve Marmara Denizi'nde hakimiyet sağlamaya yönelmiştir. Bu dönemde İtalyan şehir devletleri olan Venedik ve Ceneviz, Osmanlı Devleti'nin karşısına en büyük rakipler olarak çıkmış ve gerek denizcilik konusunda bilgi birikimleri, gerekse üstün teknolojik altyapıları nedeniyle Osmanlı donanmasının istediği düzeyde başarılı olmasına engel olmuşlardır.

Devletin imparatorluğa dönüşme sürecinde donanmanın esas görevi karasal askeri harekatlara denizden destek vererek savaş süresini kısaltmak, düşman ordularını ve kaynaklarını kara ordusunun yolundan çekmek ve kara ordusuna destek sağlamaktır. Bu dönemde donanma, kara ordusunun bir uzantısı gibi değil tek başına bir askeri kuvvet olarak seferler düzenleme gücüne erişmiştir.

Gerileme dönemindeki en önemli deniz savaşı olarak Çeşme Baskını görülmektedir. Bu baskında Baltık Denizi'nden yola çıkan Rus donanması, Çeşme'de demirli bulunan Osmanlı donanmasını yakmış, Ege Denizi'ndeki üstünlük Ruslara geçmiş ve savaş sonucunda imparatorluk ilk defa bir Avrupa devletine karşı teke tek savaşırken mağlubiyetle tanışmıştır. Bu olay sonucunda imparatorluğun denizcilik politikaları kökünden değişmiş ve 1773 yılında Mühendishane-i Bahri Hümayun okulu açılarak denizci yetiştirme çabalarına girişilmiştir. 1853'teki Sinop Baskını'nda da yine Rus Karadeniz Filosu, Sinop'ta demirli bulunan Osmanlı gemilerini imha etmiş, bu olayın sonucunda Kırım Savaşı başlamış ve bunun sonucunda da imparatorluk, Avrupa devletlerinin yarı sömürgesi haline dönüşmüştür. Sinop Baskını, buharlı ve zırhlı gemilerin çağının başlangıcı ve ahşap yelkenliler çağının bitişi anlamını da taşımaktadır. Bu savaş sonrasında Osmanlı İmparatorluğu, Avrupa sistemine entegrasyon sağlamak için gerekli girişimlere başlamıştır.

2. OSMANLI İMPARATORLUĞU'NUN BEŞ BÜYÜK DENİZ SAVAŞININ VE BU SAVAŞLARLA ŞEKİLLENEN DENİZCİLİK POLİTİKALARININ ANALİZİ

Osmanlı İmparatorluğu'nun devlet politikaları bütüncül olarak incelendiğinde kuruluş döneminden itibaren genellikle savaşa dayalı bir ekonomik ve toplumsal sistemin geliştiği görülmektedir. Devlet, kuruluş ve yükseliş dönemlerinde topraklarını genişletmeye, Avrupa sistemindeki etkinliğini askeri güç kullanarak oluşturmak ve korumak amacındadır. Duraklama, gerileme ve dağılma dönemlerinde ise eldeki toprakların korunmasına yönelik bazı modernizasyon

çalışmalarına öncelik verilmiştir. Bu açıdan bakıldığında yaşanan savaşların devlet politikalarına yön veren en önemli itici güç olduğu söylenebilir. Bu sebeple denizcilik politikalarının gelişimini de deniz savaşlarından bağımsız olarak düşünmek imkansızdır.

2.1 Preveze Deniz Muharebesi-Nedenleri ve Sonuçları

Preveze Deniz Muharebesi'ni sadece denizde olup bitmiş bir savaş olarak görmek sıg bir yaklaşım olacaktır. Bu savaşın arka planında Kanuni Sultan Süleyman ile V. Karl'ın Avrupa hakimiyeti emelleri bulunmaktadır. V. Karl'ın tüm Avrupa'ya egemen olma isteği karşısındaki en büyük engel olarak görülen Osmanlı İmparatorluğu'nun 1526'da yapılan Mohaç Savaşı'nda Macaristan'ı yenerek Orta Avrupa'da büyük bir güç olarak belirmesinden sonra iki devlet sınırdış olmuş ancak iki imparatorluk da birbirine karada tam bir üstünlük sağlayamayacağını bilincinde olarak çeşitli yıpratma savaşlarına girişmişlerdir.

Preveze Deniz Muharebesi, iki imparatorluk arasındaki bu yıpratma ve üstünlük kurma çabalarından birisi olarak 27 Eylül 1538'de bugünkü Yunanistan'ın İyon Denizi kıyılarında yer alan Preveze Limanı'nın yakınlarında gerçekleşmiştir. Osmanlı donanmasının komutası Barbaros Hayreddin Paşa'da iken Kutsal İttifak donanmasının komutası V. Karl'ın hizmetinde bulunan Andrea Doria'dadır.

Carla Rahn Phillips'e göre Preveze Deniz Muharebesi 16. yüzyılın en büyük üç deniz savaşından birisidir. Barbaros Hayreddin Paşa, kendi donanmasından daha üstün olan Kutsal İttifak donanmasına saldırmaktan çok ideal bir savunma hattı oluşturmuş ve savaşı bu şekilde sürdürmüştür. Venedik donanmasının en büyük gemisinin kaybına karşılık Osmanlı donanması sadece bir gemi kaybetmiştir. Osmanlı donanmasının başarılı ve koordineli komutasına karşılık Kutsal İttifak donanmasının komuta bütünlüğünü sağlayamaması ve bundan dolayı sayısal üstünlüğünü bir avantaja çevirememesi sebebiyle 29 Eylül 1538'de Andrea Doria geri çekilme kararı almıştır (Phillips, 2000). Bu savaşta Kutsal İttifak donanması 308'i muharip 300'ü ise destek gemisi olmak üzere toplam 608 parça gemi, 2500-2594 top ve 60.000 civarında askerden müteşekkil iken Osmanlı donanması 122 muharip sınıf gemi, 366 top ile 11.000 askerden oluşmaktaydı (Sancar, 2006).

Preveze Deniz Muharebesi, Osmanlı İmparatorluğu açısından bir savunma savaşıdır. Bununla birlikte bu savaşta Kutsal İttifak'ın gemi kaybı çok büyük olduğundan azımsanmayacak bir süre boyunca Doğu Akdeniz'in denetimi Osmanlı donanmasına geçmiştir. Hatta bu dönem Avrupalılar açısından öyle karanlık bir dönem olarak kabul edilmiştir ki (Crowley, 2008) İspanyol denizci Sandoval'ın "Mesina Boğazı'ndan Cebelitarık'a kadar Avrupa'nın o bölgesinde yaşayan tek bir kişi bile ne huzur içinde yemek yiyebiliyor ne de güvende olduğuna inanarak uyuyabiliyor" dediğini aktarmıştır. İronik olarak, savaşın kazanılmasını sağlayan esas etken, Osmanlı donanmasının bel kemiğini korsan kökenli denizcilerin oluşturmasıdır (Phillips, 2000). Avrupalıları korku içinde yaşatan bu denizciler, arka planda Osmanlı donanmasının denizcilik politikasının da bir yansımasıdır. İmparatorluk, tüm Türk

denizcilik tarihinin en parlak zaferini resmi bir eğitimden geçen değil, korsan kökenli denizciler sayesinde kazanmıştır. Savaştan sonra da bu geleneğe devam edilmiş ve bu sistemin olumsuz yanları ne yazık ki kısa sürede ortaya çıkmıştır.

2.2 İnebahtı Deniz Muharebesi-Nedenleri ve Sonuçları

İnebahtı Deniz Muharebesi'nin arka planını da Preveze Deniz Muharabesi gibi sadece denizlerde yaşanan bir hesaplaşma olarak görmek yanlış olacaktır. 6 Ağustos 1570'te Kıbrıs'ın fethedilmesiyle Venedik, Doğu Akdeniz'deki çok önemli bir üssünü kaybetmiş olmanın verdiği zararı tazmin etmek amacıyla bir Kutsal İttifak donanmasının öncülüğünü yaparak Osmanlı donanmasının üzerine gitmiştir. Preveze Limanı'nın güneyinde, bugünkü Yunanistan'ın İyon Denizi kıyılarında yer alan Korint Kıstağı'nda konuşlu olan Osmanlı donanması, bu bölgede Kutsal İttifak donanmasıyla karşılaşmıştır.

İnebahtı Deniz Muharebesi, Avrupa dünyasında antik çağlardan beri yaşanan en büyük deniz savaşı olarak kabul edilir. William Stevens (Stevens, 2009), bu savaşı "deniz platformlarında yürütülen bir piyade savaşı" olarak tanımlar. Bu savaş ayrıca tamamen kürekle sevk edilen çektiri tipi gemiler arasında gerçekleştirilen son büyük deniz savaşıdır (Hanson, 2010). İnebahtı Deniz Muharebesi'nin Osmanlı-Avrupa ilişkileri açısından bir dönüm noktası olarak nitelendirilmesinin temel sebebi, Osmanlı tehditi karşısında Avrupa devletleri için oldukça yıpratıcı ve sürekli mağlubiyetlerle dolu bir şekilde geçen 16. yüzyılın sonlarına doğru Türklerin de insan olduğunun ve yenilebileceklerinin nihayet anlaşılabilmesidir (Gürdeniz, 2015). Bu büyük hezimete rağmen Osmanlı donanması eski gücüne kısa sürede yeniden kavuşabilmiştir ki aslında bu durum, 15. ve 16. yüzyıllarda Akdeniz'de hiçbir devlet için gerçek bir hakimiyetten bahsedilememesinin de temel nedenidir. 16. yüzyılda Doğu Akdeniz'in zenginlikleriyle beslenen Osmanlı İmparatorluğu ve Güney Amerika'nın bakir kaynaklarını ülkesine taşıyan İspanyol İmparatorluğu, kısa sürede büyük donanmalar kurabilecek maddi güce sahiplerdi. Bu yüzden İnebahtı Deniz Muharebesi'nin Osmanlı-Avrupa ilişkileri açısından en önemli sonucu imparatorluğun yaşadığı itibar kaybıdır. Buna ek olarak, bu savaş sonrasında Avrupa devletleri kürekle sevk edilen kadirga tipi gemileri neredeyse tamamen terk ederek kalyon adı verilen yüksek bordalı ve rüzgar gücüyle sevk edilen gemilere geçiş sürecini tamamlayacaklardır. Osmanlılar içinse bu süreç çok daha sonra gerçekleşecektir. İmparatorluğun bu savaşta yaşadığı en büyük kayıpsa yetişmiş insan gücü olarak belirtilebilir. Bu insan gücünün kaybı, neredeyse iki yüz yıl boyunca devletin sıkıntı çektiği konulardan birisi olarak sürekli kanayan bir yara halini alacaktır.

2.3 Çeşme Deniz Muharebesi-Nedenleri ve Sonuçları

Çeşme Deniz Muharebesi, 5-7 Temmuz 1770 tarihlerinde İzmir yakınlarındaki Çeşme Limanı'nda demirli bulunan Osmanlı donanmasının, Baltık Denizi'nden gelen Rus donanması tarafından yakılmasıyla sonuçlanan ve aslında bir baskın olarak nitelendirilmesi gereken bir savaştır.

Devam eden Osmanlı-Rus Savaşı'nın bir parçası olan baskın, Rusya'nın sürekli ve dirayetli bir şekilde sürdürdüğü Akdeniz'e inme politikasının da gerçekçi bir hal aldığına göstergesidir.

Bu baskında Osmanlı donanması 12 kalyon, 6 firkateyn, 6 sünbeki, 13 kadirga ve 27 küçük tekneden oluşurken Rus donanması dokuz kalyon, 3 firkateyn ve 15 küçük tekneden ibaretti (Panzac, 2018). Her iki filoda da 900 top mevcuttu (Gürdeniz, 2015). Sayı ve konum üstünlüğünün Osmanlı donanmasında olmasına ve hatta Rus filosunun yaptığı yolculuk nedeniyle yorgun olarak değerlendirilmesine rağmen Rus donanması bu baskında Osmanlı donanmasını tamamen yok etmiştir. Limanda sıkışık halde bulunan Osmanlı gemileri, Rus ateş gemileri tarafından yakılmıştır ve 7 Temmuz sabahı gün doğduğunda felaketin boyutları anlaşılmıştır. Donanma tamamen yanmış ve 15.000 kadar denizci de hayatını kaybetmiştir. Rus donanması bu zaferden sonra Ege Denizi'ne hakim konuma geçmiş ancak Osmanlı donanmasının başarılı birkaç operasyonu neticesinde geri çekilmek zorunda kalmıştır (Panzac, 2018).

Osmanlı donanmasının bu savaşı kaybetmesinin iki temel unsuru vardır. Bunlardan ilki, donanmaya karacı kökenli bir kaptanın komuta etmesidir ki bu sebeple donanma açık deniz faaliyetlerine çıkamamış ve limanda sıkışık bir konumda demirli halde beklemiştir. İkinci sebep de kadirgadan kalyona geçiş sürecini tamamlamış olan donanmanın bu geçişi sadece gemilerle yapmış olmasıdır. Bir kadirganın sevki ve idaresi için denizci eğitimini almış personele fazla ihtiyaç duyulmamasına rağmen bir kalyonun başarılı şekilde operasyona çıkabilmesi için gerçek denizcilere ihtiyaç duyulmaktadır (Panzac, 2018). Çeşme Deniz Muharebesi'nde bu eksikliğin çok önemli olduğunun ayırıcına varılmış ve hem Osmanlı hem de Cumhuriyet dönemlerini kapsayan çok önemli bir adım atılarak 1773 yılında Mühendishane-i Bahri Hümayun açılmıştır. Bu okul, teknik ve mühendislik eğitimi kısmıyla bugünkü İstanbul Teknik Üniversitesi'nin, askeri eğitim kısmıyla da bugünkü Deniz Harp Okulu'nun temellerinin atılmasını sağlamıştır.

2.4 Navarin Deniz Muharebesi-Nedenleri ve Sonuçları

Navarin Deniz Muharebesi (20 Ekim 1827), neden ve sonuçları açısından diğer baskınlardan biraz daha farklı bir konumdadır. Baskın, Yunan isyanının başarıya ulaşmasına yardımcı olmak için bizzat Yunanlılar tarafından davet edilen İngiliz-Fransız-Rus filosunun Mora Yarımadası'nda bir liman olan Navarin'de demirli vaziyette bulunan Osmanlı donanmasını yakması sonucu meydana gelmiştir (Gürdeniz, 2015).

Müttefik filo, 12'si İngiliz, 8'i Rus ve 7'si Fransız gemisi olmak üzere 27 gemi ve 17.500 denizciden oluşmaktayken Osmanlı filosu esas olarak 3 kalyon, 22 firkateyn, 30 korvetten ve 22.000 askerden müteşekkildi (Panzac, 2018). Osmanlı filosu, müttefik filonun saldırısından habersiz bir şekilde yarımay şeklinde dizilerek müttefik filoyu selamlamak amacıyla hazırlanmıştı. Müttefiklerin ani saldırısına cevap veremeyen Osmanlı donanması, çok ağır bir zayıyata uğrayarak savaşı kaybetmiştir.

Filonun kaybı çeşitli kaynaklarda 57 gemi ve 8.000 denizci (Gürdeniz, 2015), 57 gemi ve 6.000 denizci (Gülen, 2001) olarak belirtilse de bazı kaynaklarda tam olarak kaç geminin kaybedildiğinin kesin bir şekilde bilinmediği yazmaktadır. Müttefik filo ise bu savaşta 489 yaralı ve 182 ölü vermiştir. Bazı gemiler hasar olsa da hepsi yeniden operasyona çıkabilecek durumdadır (Panzac, 2018). Navarin Deniz Muharebesi sonucunda Yunanistan'ın bağımsız bir devlet olmasının önünde bir engel kalmamış ve bağımsız Yunan devleti 1830 yılında Osmanlı Devleti tarafından tanınmıştır.

2.5 Sinop Deniz Muharebesi-Nedenleri ve Sonuçları

30 Kasım 1853'te Osmanlı donanmasının modernleşmesinden önce yaşanan son deniz savaşı olan Sinop Deniz Muharebesi, devam eden Osmanlı-Rus savaşında Osmanlı gemilerinin Kafkas Cephesi'ne yardım götürmek için Karadeniz filosunun zayıflatılması amacıyla gerçekleşmiş ve Rus Karadeniz Filosu'nun Sinop'ta demirli halde bulunan Osmanlı donanmasını bozguna uğratmasıyla sonuçlanmıştır.

Osmanlı Karadeniz Filosu Mısır gemilerinin de takviyesiyle 10 kalyon, 5'i buharlı 22 firkateyn, 1'i buharlı 21 korvetten oluşurken Rus Karadeniz Filosu 18 kalyon, 12 firkateyn ve 2'si buharlı 10 korvetten oluşmaktaydı (Panzac, 2018). Birbirine denk gözüken bu iki güç, karşı karşıya geldiğinde Osmanlı filosunun tereddüdü ve Rus filosunun dünya tarihinde ilk kez olmak üzere yekpare demirden oluşan gülle yerine içi patlayıcı dolu humbaraları kullanmasıdır (Gürdeniz, 2015). Savaş sonucunda Osmanlı donanması 4.200 kişilik mürettebatının 2.000 kadarını kaybetmiştir. Rus filosunun kaybı ise 37 ölü ve 229 yaralıdan ibaret kalmıştır. Ruslar, Sinop tersanesi ve şehrini de yakarak üslerine geri dönmüşlerdir (Panzac, 2018).

Rusların bu kesin zaferi karşısında Rus yayılmasının tehlikeli bir hal aldığı görülen İngiltere ve Fransa'nın Osmanlı Devleti yanında yer almasıyla Kırım Savaşı başlamıştır. Bu savaş sırasında Osmanlı Devleti ilk kez dış borç alarak geri kalan ömrünü Avrupa devletlerine bağımlı halde yaşamak durumunda kalmıştır. Savaşın bir diğer sonucu da ilk kez kullanılan ve korkunç etkileri olduğu görülen humbaralar nedeniyle ahşap yelkenliler çağının kapanmasıdır. Bu savaştan sonra buhar gücüyle sevk edilen ve çelikten imal edilen gemiler dünya sahnesinde yer almaya başlamıştır.

3. SONUÇLAR

Osmanlı İmparatorluğu'nun denizcilik politikaları, genellikle yaşanan savaşlar sonucunda belirlenmiştir. I. Süleyman devrine kadar bağımsız bir denizcilik politikası olmadığı görülen imparatorluk, bu dönemde gerek maddi olarak gerekse yetmişmiş insan gücü açısından doruk noktasına ulaşarak Doğu Akdeniz'in hakimi konumuna yükselmiştir. Önemli bir galibiyet olan Preveze Deniz Muharebesi'nde donanmayı zafere götürmek için esas unsur, yetenekli amirallerle korsan kökenli denizcilerin varlığıdır. Dolayısıyla devletin deniz politikalarını denizci bir yaklaşımla belirlemediği düşünülebilir. Bu eksiklik, İnebahtı Deniz Muharebesi'nde büyük bir hezimet olarak kendisi göstermiştir. Bu savaşta sonrasında Osmanlı donanması önemli bir güç olarak kısa sürede yenilse de Avrupa devletlerinin bu

bölgeye olan ilgisinin azalması da Doğu Akdeniz'deki Türk hakimiyetinin sürmesinde donanma gücüyle eşit derecede rol oynamıştır.

Çeşme Deniz Muharebesi, Osmanlı İmparatorluğu'nun yaşadığı tüm savaşlar içerisinde etkisi hala önemli şekilde süren bir savaştır. Bu savaş sonucunda yaşanan hezimet, Mühendishane-i Bahri Hümayun'un ve dolayısıyla bugünkü İstanbul Teknik Üniversitesi ile Deniz Harp Okulu'nun kurulmasına etki etmiştir. Navarin Deniz Muharebesi, bütün savaşlar arasında etkisi en kısıtlı savaş olarak görülmektedir ve savaş sonucunda bağımsız Yunanistan tanınmıştır. Sinop Deniz Muharebesi sonucunda ise Osmanlı Devleti'nin Karadeniz'deki gücü neredeyse imha edilmiş ve dünya tarihinde buharlı ve zırhlı gemilerin çağı başlamıştır.

Bütün bu savaşlar incelendiğinde Osmanlı Devleti'nin yaşadığı beş büyük deniz savaşının dördünü acı verici şekilde kaybettiği ve kayıpların nedenlerinin teknik eksiklikler olduğu görülmektedir. Savaş sonucunda yaşanan insan gücü kayıpları da bir sonraki savaşın kaybını tetiklemiştir. Devlet, ne yazık ki Preveze Deniz Muharebesi de dahil olmak üzere hiçbir savaştan ders çıkararak gerekli önlemleri alamamıştır. Gelişimini çoğu zaman karacı bir devlet olarak sürdüren Osmanlı Devleti'nin, çoğunlukla yetersiz ve dar vizyonlu bir denizcilik politikasına sahip olduğu görülmektedir.

REFERANSLAR

- Badem, C. (2012) "Müşavir Paşa'nın Kırım Harbi Anıları. İstanbul", Türkiye: Türkiye İş Bankası Yayınları.
- Crowley, R. (2008) "İmparatorların Denizi Akdeniz", İstanbul, Türkiye: April Yayıncılık
- Gülen, N. (2001) "Şanlı Bahriye-1773-1973 Türk Bahriyesinin İkiyüz Yıllık Tarihçesi", İstanbul, Türkiye: Kastaş Yayınları.
- Gürdeniz, C. (2015) "Mavi Uygarlık-Türkiye Denizcileşmelidir", İstanbul, Türkiye: Kırmızı Kedi Yayınevi.
- Hanson, V. D. (2010) "The Father of Us All: War and History, Ancient and Modern", New York, Amerika Birleşik Devletleri: Bloomsberry Press.
- Panzac, D. (2018) "Osmanlı Donanması (1572-1923)", İstanbul, Türkiye: Türkiye İş Bankası Kültür Yayınları.
- Phillips, C. R. (2000) "Navies and the Mediterranean in the Early Modern Period", Part-I, Section-I, Naval Strategy and Policy in the Mediterranean, Past, Present and Future, Editör: Hattendorf J. B. Londra, Birleşik Krallık: Frank Cass Publishers.
- Sancar, E. (2006) "21. Yüzyıl Stratejilerinde Türk Denizcilik Tarihi", İstanbul, Türkiye: IQ Kültür Sanat Yayıncılık.

ICOAEF'18 IV. International Conference on Applied Economics and Finance

& EXTENDED WITH SOCIAL SCIENCES

November 28-29-30, 2018 / Kuşadası - Turkey

Stevens, W. (2009) ‘‘History of Sea Power’’, Bremen, Almanya: Salzwasser-Verlag.

