



Aycan Kulaksız¹

Araştırmacı

Etki Analizi Merkezi

Şehir Çalışmaları Programı

Merve Dündar²

Araştırmacı

İnovasyon Çalışmaları Programı

Şehir Çalışmaları Programı

TEPAV PERAKENDE GÜVEN ENDEKSİ İLE TÜİK PERAKENDE TİCARET SEKTÖRÜ GÜVEN ENDEKSİ ARASINDAKİ FARKLAR NEREDEN KAYNAKLANMAKTADIR?

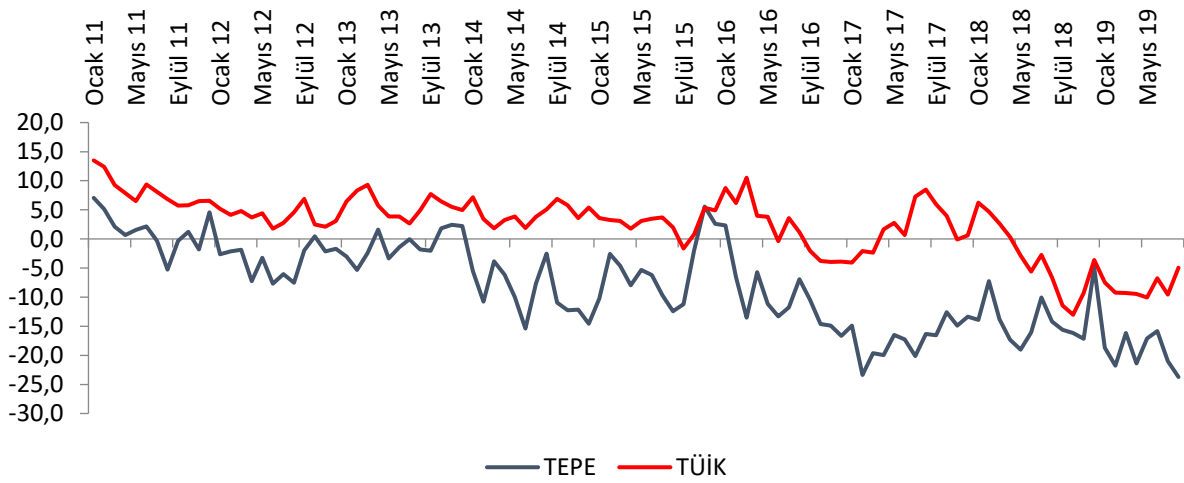
TEPAV Perakende Güven Endeksi (TEPE), Avrupa Birliği Uyumlaştırılmış İşyeri ve Tüketici Anketleri Ortak Programı kapsamında Mayıs 2008'de uygulanmaya başlandı. TEPE, perakende sektöründeki mevcut durumu değerlendirme ve sektörün yakın gelecek için beklentilerini gözlemlemek amaçlarıyla hazırlanmaktadır. TÜİK ise Mayıs 2011'den itibaren Avrupa Birliği Uyumlaştırılmış İşyeri ve Tüketici Anketleri Ortak Programı kapsamında, TÜİK Perakende Ticaret Güven Anketini uygulamaya başlamıştır. Her ne kadar iki endeks de aynı program çerçevesinde, aynı temayı benzer soru setleriyle incelese de bu iki endeksin yıllar içerisinde birbirlerinden farklı eğilimler izlediği görülmektedir. Bu yazıda, TÜİK Perakende Ticaret Sektörü Güven Endeksi ve TEPAV Perakende Güven Endeksi (TEPE) arasında gözlemlenen farklılıkların kaynaklarına değinilmektedir. **TEPE ile TÜİK arasındaki en önemli fark işletme büyüklüklerinden kaynaklanmaktadır.** TÜİK, İşyeri Eğilim İstatistikleri kapsamında perakende ticaret sektörüne uygulanan aylık eğilim anketi, sadece 10 ve üzeri çalışana sahip özel sektör girişim yöneticilerine uygulanmaktadır. TEPAV Perakende Güven Endeksi anketleri ise özel sektör girişim yöneticilerine çalışan sayılarına göre bir kısıt gözetmeksizin uygulanmaktadır. TEPAV Perakende Güven Endeksi anketlerinin büyük çoğunluğu 1-9 çalışanı olan işletmelere uygulanmaktadır.

¹ <http://www.tepav.org.tr/tr/ekibimiz/s/1332/Aycan+Kulaksiz>

² <https://www.tepav.org.tr/tr/ekibimiz/s/1376/Mukaddes+Merve+Dundar>

TÜİK Perakende Ticaret Güven Endeksi ve TEPAV Perakende Güven Endeksi'nin karşılaştırılmasına bakıldığında endeks değerlerinde ve eğilimlerinde farklılıklar görülmektedir. Örneğin, eğilimde ilk farklılaşma Nisan 2011'den Mayıs 2011'e TEPAV perakende güven endeksinde artış, TÜİK perakende ticaret sektörü güven endeksinde azalış yaşanmasıyla gözlenmekte ve aynı farklılık birçok aylık değişimde görülmektedir. Şubat 2019'dan Mart 2019'a ve Nisan 2019'dan Mayıs 2019'a TEPE endeksinde artış, TÜİK endeksinde azalış gözlenmektedir. Temmuz 2019'dan Ağustos 2019'a TÜİK perakende ticaret sektörü güven endeksinde artış gözlenirken; TEPAV perakende güven endeksinde azalış gözlenmektedir (Şekil 1). Bu farklılıkların muhtemel açıklayıcıları olarak alt başlıklarda değerlendirmeler yapılmıştır.

Şekil 1 TÜİK Perakende Ticaret Sektörü Güven Endeksi ve TEPAV Perakende Güven Endeksi (TEPE) karşılaştırması (Ocak 2011 - Ağustos 2019)



Kaynak: TÜİK Sektörel Güven Endeksleri, Perakende Ticaret Güveni ve TEPAV Perakende Güven Endeksi (Mevsimsellikten Arındırılmış Veriler)

Not: TÜİK endeks hesabı yaparken elde edilen denge katsayısına 100 eklemektedir. TEPE'de ise Avrupa Birliği'nde olduğu gibi elde edilen denge katsayısı kullanılmaktadır. İki endeksin kolay karşılaştırılabilmesi için TÜİK endeksinden 100 çıkarılmıştır.

1. Kapsanan İşletmeler (Örneklem)

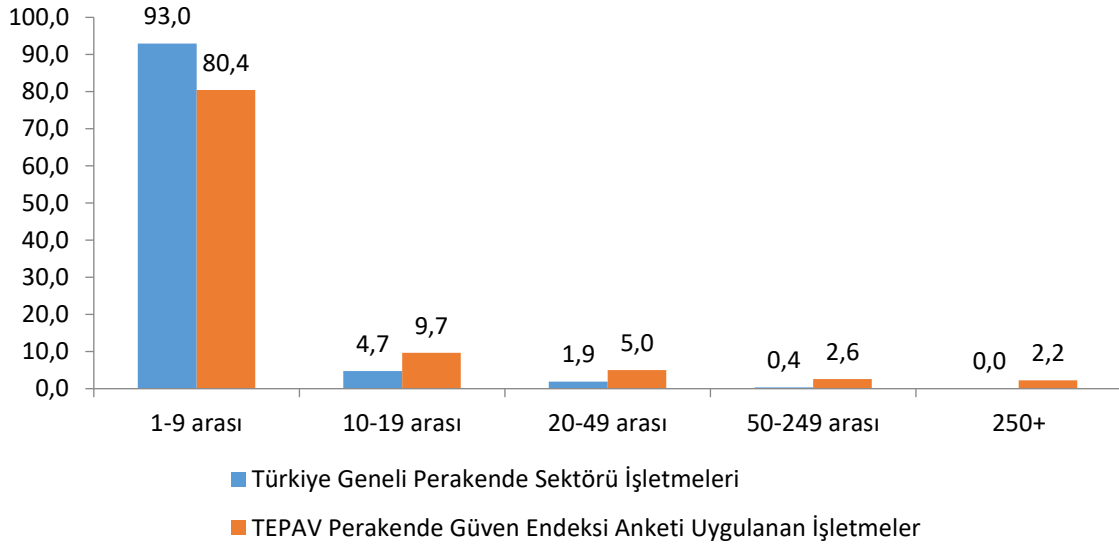
1.a. İşletme büyüklükleri:

TÜİK, İşyeri Eğilim İstatistikleri kapsamında perakende ticaret sektörüne uygulanan aylık eğilim anketi, 10 ve üzeri çalışana sahip özel sektör girişim yöneticilerine uygulanmakta, 1-9 çalışana sahip işletmeler anket örneğine dâhil edilmemektedir. TEPAV Perakende Güven Endeksi anketleri ise özel sektör girişim yöneticilerine çalışan sayılarına göre bir kısıt gözetmeksizin uygulanmaktadır.

Türkiye'de perakende sektöründeki işletmelerin, çalışan sayılarına göre büyüklüklerinin dağılımına bakıldığında, 1-9 çalışan sayısına sahip mikro ölçekli işletmelerin toplam işletmelerin yüzde 93'ünü oluşturduğu görülmektedir (Şekil 2). TEPE örneğinde işletmelerin büyüklük dağılımına bakıldığında, Türkiye geneli perakende sektörü işletme büyüklükleriyle uyumlu bir dağılım izlendiği, 1-9 çalışanı olan işletmelerin yüzde 80,4 paya sahip olduğu görülmektedir. Türkiye genelinde perakende sektöründeki işletmelerin yüzde 93'ünü oluşturan 1-9 arası çalışana sahip firmaların ayrıca toplam çalışan sayısınının 60,7'sine istihdam sağladığı düşünüldüğünde, TEPE'nin Türkiye perakende sektöründe gerek işletme,

gerekse istihdam sayısı bakımından önemli paya sahip bir bölümünü Perakende Güven Endeksi hesaplamalarına dâhil ettiği anlaşılmaktadır.

Şekil 2 İşletmelerin çalışan sayılarına (büyüklüklerine) göre dağılımı



Kaynak: SGK Aylık Sigortalı İstatistikleri Mayıs 2019, TEPAV Perakende Güven Endeksi Anketi³ ve TEPAV hesaplamaları

Not: TEPAV Perakende Güven Endeksi Anketine ait Mayıs 2019'a ait örneklem grubuna ait istatistikler paylaşılmıştır.

1.b. Örneklemin yenilenmesi

TÜİK perakende ticaret güven anketi için örneklem çerçevesi her yıl güncellenmektedir. Yıl içerisinde kapanan ve ana faaliyeti bulunduğu sektörün dışına çıkan girişimler takipten çıkarılmaktadır. Yıl içerisinde sadece sektör içindeki faaliyet kaymaları dikkate alınmaktadır. TEPAV perakende güven endeksi anketinin çerçevesi de her yıl yenilenmekte, kapanan ve ana faaliyeti bulunduğu sektörün dışına çıkan girişimler takipten çıkarılmaktadır. Fakat yıl içerisinde sektör kaymaları takip edilmemektedir.

2. Uygulama Yöntemi

TÜİK, Aylık İşyeri Eğilim Anketini aylık olarak internet üzerinden uygulamaktadır. İlgili anket, her ayın 1-15. günleri arasında yapılmaktadır. TEPAV Perakende Güven Endeksi Anketi ise yine her ay uygulanmakta olup TÜİK anketinden farklı olarak her ayın 5-25. günleri arasında uygulanmaktadır. Ayrıca, TEPE anketinin uygulanma aşamasında, Mayıs 2008-Nisan 2011 döneminde yüz yüze görüşmeler gerçekleştirilirken, Mayıs 2011'den bu yana kademeli olarak yüz yüze görüşmelerden telefonla görüşmelere geçilmiştir. TEPE anketlerinin tamamı, 2014'den bu yana telefonla uygulanmaktadır. İki ankette de görüşülen firmalar örneklem kriterlerine uygun olarak her ay değişmektedir.

TÜİK perakende ticaret güveni anketi ile TEPAV perakende sektörü güven endeksi anketinin ilk altı sorusu aynıdır. Bu 6 soru anketlerin ana sorularıdır. Endeks hesaplanırken 1., 2. ve 4. sorular kullanılmaktadır. Ortak olan sorularda, soru soruş şekilleri farklılık göstermektedir.

³ SGK'dan perakende sektörü için NACE Rev.2 45 ve 47. sektörleri analiz kapsamında incelenmiştir.

Örneğin; birinci soruyu TÜİK, “Son 3 aydaki iş hacminiz (satışlarınız) nasıl değişti?”, TEPE, “Son 3 ayı düşündüğünüzde iş hacminizde (satışlarınızda) nasıl bir gelişme oldu?” ifadeleriyle sormaktadır. TEPE anketindeki soruların soruş şekli, AB genelinde uygulanan anketin sorularının soruş şekli ile aynıdır.

3. Sınıflamalar

Her iki ankette de Avrupa Topluluğunda Ekonomik Faaliyetlerin İstatistik Sınıflaması, NACE Rev.2 sektör sınıflaması kullanılmaktadır. İki anketin de örneklem grubunu perakende sektörü oluştururken, perakende sektörü NACE Rev.2 sınıflaması ile uyumlu olarak

- “Motorlu kara taşıtlarının ve motosikletlerin toptan ve perakende ticareti ile onarımı (45)” ve
- “Perakende ticaret (Motorlu kara taşıtları ve motosikletler hariç) (47)” faaliyet kodlarını kapsamaktadır.

Bu faaliyet kodlarından, Avrupa Komisyonu, İşyeri ve Tüketici Anketleri Kullanıcı Kılavuzu tarafından hariç tutulması önerilen 4'lü faaliyet kodları dışlanmaktadır. 2017'de TÜİK bu uygulamaya Avrupa Komisyonu'nun güncellemesine göre son verirken TEPAV, Mayıs 2008'den bu yana seçili 4'lü faaliyet kodlarının dışlandığı sektör sınıflaması ile anketlerini 2018'e kadar devam ettirmiş sonrasında bu uygulamaya son vermiştir.

4. Veri Analizi

Anket verilerinin analizi sırasında TEPE ve TÜİK, temelde Eurostat tarafından önerilen standartları baz almakla beraber iki endeksin analizi sırasında yöntemsel farklıklara rastlanmaktadır.

4.a. Mevsimsellikten Arındırma

TÜİK ve TEPAV, Sektörel Güven Endekslerinin (SGE) ve TEPE'nin mevsimsel düzeltmesini, İspanya Merkez Bankası tarafından geliştirilen ve aynı zamanda Eurostat tarafından önerilen ARIMA modeline dayalı TRAMO-SEATS yöntemini kullanarak yapmaktadır. TÜİK, bu yöntemin uygulanmasında Almanya Merkez Bankası ve Avrupa Birliği İstatistik Ofisi işbirliği ile Belçika Merkez Bankası tarafından Avrupa İstatistik Sistemi yönergeleri doğrultusunda geliştirilmiş olan JDemetra+ yazılımını kullanmaktadır. TEPE'de ise aynı yazılımın 1.0.3 sürümü kullanılmaktadır.

TÜİK ve TEPE endeks hesaplamasında dolaylı yaklaşım kullanılmaktadır. Dolaylı yaklaşımda önce alt bileşenler mevsim etkilerinden arındırılmaktadır. Daha sonra, arındırılmış veriler toplulaştırılarak mevsim etkilerinden arındırılmış toplulaştırılmış veriler elde edilmektedir.

Mevsim etkisinden arındırma süreci, TÜİK için her yılın sonunda bir sonraki yılın model, takvim etkisi ve aykırı değer kompozisyonunun belirlenmesi ile başlamakta ve bu kompozisyon sabit tutularak, yıl boyunca tüm aylar için mevsimsel faktörler projekte edilmektedir. Böylelikle mevsim etkilerinden arındırma için kullanılan faktörler tüm aylar için yıl boyunca sabitlenmektedir. Bu işlem her yıl tekrarlanmaktadır. TEPE endeksi için JDemetra'da önceden tanımlanmış filtreler/parametreler/özellikler kullanılmaktadır. Bu nedenle yapılan ön arındırma işlemi ve ARIMA modelleri program tarafından belirlenmekte, dışarıdan müdahale edilmemektedir.

TÜİK tarafından mevsim etkilerinden arındırılmış veriler, Avrupa Birliği İstatistik Ofisi'nin tavsiyelerine uygun olarak, cari yıl ve önceki üç yıl güncellenerek yayımlanmaktaydı. Fakat 2016 yılı itibarıyla; geçmişe dönük revizyon işlemi terk edilmiştir. TEPE'de ise veriler halen geçmişe dönük güncellenmektedir.

4.b. Cevapsızlık Düzeltmesi

Cevapsızlık hatası, kapsam dâhilinde olan bir birim bilgilerinin alınamaması durumunda ortaya çıkmaktadır. Bu durum, uygulama yapılması gereken örneklem genişliğinin azalmasına, varyans değerinde artışa ve araştırma tahminlerinde yanlılığa neden olabilmektedir.

Cevapsızlık düzeltmesi, cevapsızlık oranları üzerinden hesaplanır. Araştırmanın yapısına bağımlı olarak bazen tek bazen iki bazen üç bileşenden oluşabilir. Araştırmaya ait hesaplanan cevapsızlık oranları, araştırmanın kalitesini belirleyen göstergelerden biridir. Cevapsızlık düzeltmesi mümkün olan homojen birimler üzerinden gerçekleştirilmelidir.

TÜİK, örnekleme belirlediği girişimler için yedek girişim seçmemektedir. Bu nedenle ankete cevap vermeyen girişimler için TÜİK tarafından cevapsızlık düzeltmesi yapılmaktadır. TEPE anketinde bir girişimin bilgilerinin alınamaması durumunda yedek girişim ile görüşme yapıldığı için örneklem sayısı tamamlanmakta ve cevapsızlık düzeltmesi kullanmaya ihtiyaç duyulmamaktadır.

5. Hesaplama Yöntemi

TÜİK ve TEPE endeksi, Avrupa Birliği'nin kullandığı denge yöntemine göre hesaplanmaktadır. Bu yöntemde, sorulara pozitif cevap verenlerin yüzdesinden negatif cevap verenlerin yüzdesi çıkartılarak bir denge katsayısı elde edilmektedir.

TÜİK bu denge katsayısına 100 ilave ederek her bir soru için yayılma endeksi hesaplamaktadır. Güven endeksi; endekse seçilen soruların yayılma endekslerinin aritmetik ortalaması olarak hesaplanmaktadır. Endeks, 0-200 aralığında değer almakta, endeksin 100'den büyük olması sektörün mevcut ve gelecek döneme ilişkin iyimserliğini, 100'den küçük olması ise kötümserliğini göstermektedir. TEPE endeksinde ise denge katsayısına 100 eklenmemektedir. Endeks; endekse seçilen soruların denge katsayılarının aritmetik ortalamasıdır. Endeks değerleri pozitif ise iyimserliği negatif ise kötümserliği göstermektedir.

Her iki endeks için mevcut mal stok düzeyi endeksinin artışı stok azalışını, stok düzeyi endeksindeki azalış ise stok artışını ifade etmektedir.

ÖZET

TEPAV Perakende Güven Endeksi (TEPE) ve TÜİK Perakende Ticaret Güven endeksi her ne kadar aynı temayı benzer soru setleriyle incelese de bu iki endeksin yıllar içerisinde birbirlerinden farklı eğilimler izlediği görülmektedir. Bu iki endeks arasındaki farklı eğilimleri anlamlandırabilmek için aralarındaki farklara bakmak gerekir. Bu farklılıklar;

TÜİK anketi, 1-9 arası çalışan sayısına sahip firmalara uygulanmazken; Türkiye'deki perakende sektöründe faaliyet gösteren firmaların çalışan sayısı dağılımına daha uygun olarak TEPE anketi, yoğun olarak 1-9 arası çalışan sayısına sahip firmalara uygulanmaktadır. Anketlerin uygulama zamanları farklılık göstermektedir. TÜİK anketi her ayın 1. ve 15. günleri arasında uygulanırken; TEPE anketi her ayın 5. ve 25. günleri arasında uygulanmaktadır.

Her iki endeks içinde örnekleme çerçevesi her yıl yenilenmektedir. Fakat TEPE anketi uygulanırken yıl içindeki sektör kaymaları dikkate alınmamaktadır.

TÜİK anketi için cevapsızlık düzeltilmesi yapılırken; TEPE anketi için cevapsızlık düzeltilmesi yapılmamaktadır. Mevsimsellikten arındırma için aynı yöntemler kullanılmaktadır. TÜİK her yılın sonunda bir sonraki yıl için mevsimsellikten arındırma faktörlerini belirlemekte ve bu faktörleri yıl boyunca sabit tutmaktadır. TEPE için ise arındırma işlemi programın önceden tanımlanmış özellikleri kullanılarak yapılmaktadır.

2016 yılı itibarıyla; TÜİK verileri geçmişe dönük revize edilmemektedir. TEPE verileri ise geçmişe dönük revize edilmektedir.

Her iki endekste sorulara verilen pozitif cevap verenlerin yüzdesinden negatif cevap verenlerin yüzdesi çıkartılarak denge katsayısı elde edilmektedir. Yalnızca mevcut stok düzeyi endeksindeki artış stok düzeyindeki azalışı ifade etmektedir.

TÜİK, 1., 2. ve 4. soruların denge katsayısına 100 ilave ederek her bir soru için yayılma endeksi hesaplamaktadır. Bu soruların yayılma endekslerinin aritmetik ortalaması alınarak endeks hesaplanmaktadır. TEPE için AB'de olduğu gibi yayılma endeksi hesaplanmamakta (denge değerine 100 ilave edilmemekte) ve güven endeksi; endekse seçilen soruların denge değerinin aritmetik ortalaması olarak hesaplanmaktadır.

Kaynaklar

TÜİK, Kaliteli Bir Araştırmanın El Kitabı

TOBB, Sorularla Örnekleme, Araştırma ve Veri Derleme, Sorularla Merak Ettikleriniz Yayın Serisi-2; <https://www.tobb.org.tr/Documents/yayinlar/seri-yayinlar/SY-Sorular-ornekler.pdf>

TÜİK, Mevsimsel Etkilerinden Arındırılmış Sektörel Güven Endeksleri, Meta Veri, 2019