

TÜRKİYE İSTATİSTİK KURUMU BAŞKANLIĞI

Örnekleme ve Analiz Teknikleri Daire Başkanlığı

MEVSİM

ETKİLERİNDEN

ARINDIRILMIŞ

TÜKETİCİ GÜVEN

ENDEKSLERİ

METAVERİ

Veri Analiz Teknikleri Grubu

2019

İÇİNDEKİLER

MEVSİM VE TAKVİM ETKİLERİNDEN ARINDIRILMIŞ TÜKETİCİ GÜVEN ENDEKSLERİ	1
ÖN-ARINDIRMA.....	3
MEVSİM ETKİLERİNDEN ARINDIRMANIN ÖZELLİKLERİ.....	7
REVİZYON POLİTİKALARI.....	8
MEVSİM ETKİLERİNDEN ARINDIRMANIN KALİTESİ.....	9
MEVSİM VE TAKVİM ETKİLERİNDEN ARINDIRMA ÜZERİNE ÖZEL KONULAR.....	9
MEVSİM VE TAKVİM ETKİLERİNDEN ARINDIRILMIŞ VERİNİN SUNUMUNA İLİŞKİN KONULAR	10
REFERANSLAR	10

MEVSİM VE TAKVİM ETKİLERİNDEN ARINDIRILMIŞ TÜKETİCİ GÜVEN ENDEKSLERİ

Mevsim ve Takvim Etkilerinden Arındırma Nedir?

Verilerde yıldan yıla yinelenen ve yılın bazı ay/dönemlerinde ortaya çıkan periyodik artış ya da azalışlar mevsimsel etkiler olarak adlandırılırken, ay/dönem/yıl içindeki takvim kompozisyonuna bağlı olarak oluşan etkiler takvim etkileri olarak adlandırılmaktadır. Mevsim ve takvim etkisinden arındırma ise mevsim ve takvim etkilerinin istatistiksel yöntemler kullanarak tahmin edilmesi ve eğer anlamlı ise veriden ayrıştırılması işlemidir.

Tüketici Güven Endeksleri Neden Mevsim Etkilerinden Arındırılıyor?

Mevsimden kaynaklanan etkiler, geçici nitelikte olduklarından, verinin genel eğiliminin gözlemlenmesini engellemektedirler. Mevsimsel hareketler içeren veride, belirli bir dönemde meydana gelen değişikliğin, verideki reel artış veya azalıştan mı, yoksa mevsimsel etkilerden mi kaynaklandığını anlamak oldukça güçtür. Oysa, karar verme ve planlama faaliyetleri için gerekli olan kısa dönemli göstergelerin, istenen dönemler arasında sağlıklı karşılaştırma yapmaya olanak sağlayacak şekilde üretilmesi büyük önem arz etmektedir. Kısa dönemli göstergelerde dönemlik/aylık ve yıllık değişimlerin sağlıklı bir şekilde yorumlanabilmesi için, bir önceki döneme/aya göre yapılacak karşılaştırmalarda mevsim etkilerinden arındırılmış göstergelerin kullanılması, bir önceki yılın aynı dönemine/ayına göre yapılacak karşılaştırmalarda ise takvim etkisinden arındırılmış göstergelerin kullanılması daha anlamlı olacaktır.

Güven düzeyinde azalışın/artışın her yıl aynı dönemlerde görülmesi mevsimsel etkilere işaret etmektedir. Daha sağlıklı bir bilgi seti için mevsim etkilerinden arındırma işlemi yapılmalıdır.

Mevsim Etkilerinden Arındırılmış Endeksler

Tüketici Güven Endeksleri (TGE) kapsamında yer alan 18 endeksin 8'inde mevsimsel etki bulunurken, hiçbir seride takvim etkisi bulunmamaktadır (Tablo 1). Bu nedenle, TGE verileri mevsim etkilerinden arındırılarak yayımlanmaktadır.

Tablo 1. Tüketici Güven Endeksleri

Seri Kodu	Seri Adı	Mevsimsellik
HANE_MADDI	Hanenin maddi durumu (geçen 12 aylık döneme göre mevcut dönemde)	X
HANE_MADDI_BEK	Hanenin maddi durum beklentisi (gelecek 12 aylık dönemde)	
GED	Genel ekonomik durum (geçen 12 aylık döneme göre mevcut dönemde)	
GED_BEK	Genel ekonomik durum beklentisi (gelecek 12 aylık dönemde)	
ISZ_BEK	İşsiz sayısı beklentisi (gelecek 12 aylık dönemde)	
YDTUK_HAR	Yarı-dayanıklı tüketim mallarına yönelik harcama yapma düşüncesi (geçen 3 aylık döneme göre gelecek 3 aylık dönemde)	X
DLT_UYG	Mevcut dönemin dayanıklı tüketim malı satın almak için uygunluğu	
DLTTUK_HAR	Dayanıklı tüketim mallarına yönelik harcama yapma düşüncesi (geçen 12 aylık döneme göre gelecek 12 aylık dönemde)	
TAS_UYG	Mevcut dönemin tasarruf etmek için uygunluğu	
HANE_MALI	Hanenin içinde bulunduğu mali durum	X
TAS_BEK	Tasarruf etme ihtimali (gelecek 12 aylık dönemde)	X
BORC_BEK	Tüketimin finansmanı amacıyla borç kullanma ihtimali (gelecek 3 aylık dönemde)	
TUFE_DUS	Tüketici fiyatlarının değişimine ilişkin düşünce (geçen 12 aylık dönemde)	X
TUFE_BEK	Tüketici fiyatlarının değişimine ilişkin beklenti (geçen 12 aylık döneme göre gelecek 12 aylık dönemde)	
UCR_BEK	Ücretlerin değişimine ilişkin beklenti (geçen 12 aylık döneme göre gelecek 12 aylık dönemde)	X
OTO	Otomobil satın alma ihtimali (gelecek 12 aylık dönemde)	
KONUT_TAMIR	Konut tamiratına para harcama ihtimali (gelecek 12 aylık dönemde)	X
KONUT	Konut satın alma veya inşa ettirme ihtimali (gelecek 12 aylık dönemde)	X
TGE	Tüketici güven endeksi	DOLAYLI

ÖN-ARINDIRMA

Ön-Arındırmada Yapılan İşlemler

Veriler mevsimsel etkilerden arındırılmadan önce ön arındırma yapılması, uygulamada sıkça başvurulan bir yöntemdir. Ön arındırmada; verilere uygun dönüşümler yapıldıktan sonra aykırı değerler tespit edilmekte, varsa kayıp veriler tahmin edilmekte ve istatistiksel olarak anlamlı takvim etkileri veriden arındırılmaktadır. Bu süreçte elde edilen veri “doğrusallaştırılmış” duruma gelmektedir. Doğrusallaştırılmış veri, sonraki aşama olan ayrıştırma aşamasında simetrik filtrelerin kullanılabilmesi için ARIMA modelleriyle (geri ve ileri yönlü) genişletilmektedir. Ön-arındırmada doğrusallaştırılan ve genişletilen veriler ayrıştırma aşamasında bileşenlerine ayrıştırılmaktadır.

Takvim Etkisinden Arındırma

Bir ay içinde takvim kompozisyonuna bağlı olarak iş günü sayısının değişmesi, ekonomik göstergeleri önemli ölçüde değiştirebilir. Bu nedenle dönemlik/aylık ve yıllık değişimlerin sağlıklı bir şekilde yorumlanabilmesi için verilerin takvim etkilerinden arındırılması son derece önemlidir.

Takvim Etkileri, yıl içinde takvim kompozisyonuna bağlı olarak oluşan etkiler olup kendi içinde “iş günü” (working-day) etkisi, “ticaret günü” (trading-day) etkisi, “artık yıl” (leap-year) etkisi, “tatil” (holiday) etkisi gibi kategorilere ayrılır.

Ticaret/İş Günü/Artık Yıl Etkileri İçin Arındırma

Ticaret günü etkisi, Cumartesi gününü de içine alan haftanın 6 gününün dönem/ay içinde tekrarlanma sayısına bağlı olarak oluşurken iş günü etkisi, bir dönem/ay içinde hafta içi günler olarak bilinen 5 günün kompozisyonuna ve tekrarlanma sayısına bağlı olarak oluşur. Artık yıl etkisi ise Şubat ayının kapsadığı gün sayısının artık yıllarda değişmesinden kaynaklanan etkidir.

Tatil ve Hareketli Tatil Etkileri İçin Arındırma

Her yıl belirli günlerde resmi tatillerin veri üzerinde yapmış olduğu etki tatil etkisi olarak adlandırılırken, dini tatillerin yıllara göre değişen zamanlarda yapmış oldukları etkiler de hareketli tatil etkisi olarak adlandırılır. Örneğin ülkemizde ekonomik aktiviteler Ramazan Bayramı ve Kurban Bayramı gibi dini tatillerin denk geldiği dönemlerde önemli ölçüde etkilenmektedir.

Türkiye için Takvim Etkileri

Türkiye İstatistik Kurumu olarak resmi istatistik üretim süreci kapsamında üretilen göstergelerde kullanılan takvim etkilerini aşağıdaki 4 temel başlıkta gruplandırmak mümkündür.

1. Hafta sonu (Cumartesi-Pazar) veya Pazar etkisi
2. Miladi takvime bağlı sabit (resmi) tatiller (1 Ocak, 23 Nisan, 1 Mayıs, 19 Mayıs, 15 Temmuz, 30 Ağustos, 28-29 Ekim)
3. Hicri takvime bağlı hareketli (dini) tatiller (arefe günleri ile birlikte Ramazan ve Kurban bayramları)
4. Artık yıl (28 Şubat) etkisi

Üretim süreci kapsamında bu 4 temel takvim etkisini kullanarak farklı kombinasyonlar ile Tablo 2’de yer alan takvim etkisi spesifikasyonları kullanılmaktadır. Avrupa İstatistik Sistemi Mevsimsel Düzeltme Rehberine göre takvim etkisinden arındırma sürecinde ilgili seriden takvim etkisinin yalnızca mevsimsel olmayan bölümü arındırılmalıdır. Türkiye İstatistik Kurumu olarak kullanılan takvim etkilerinin mevsimsel kısmını arındırmak üzere miladi ve hicri takvim döngülerini tam olarak kapsayacak şekilde uzun dönemli teorik ortalamalar kullanılmıştır. Türkiye İstatistik Kurumu, takvim etkisinden arındırma aşamasında modele dayalı bir yaklaşım kullanmaktadır. Basit bir ifadeyle, ilgili verilerin açıklanan değişken olarak kullanıldığı modelin sağ tarafında açıklayıcı değişkenlerden biri olarak takvim etkisi değişkeni kullanılmaktadır. İstatistiksel anlamlılık sınaması gerçekleştirilen takvim etkileri Tablo 2’de sunulmuştur.

TGE serilerinde takvim etkisi anlamlı değildir.

Tablo 2. TGE kapsamında incelenen takvim etkileri

No	Etkiler
1	Toplam gün sayısı; Cumartesi, Pazar hariç
2	Toplam gün sayısı; Pazar hariç
3	Toplam gün sayısı; Cumartesi, Pazar, resmi ve dini tatil hariç
4	Toplam gün sayısı; Pazar, resmi ve dini tatil hariç
5	Toplam gün sayısı; Cumartesi, Pazar ve dini tatil hariç
6	Toplam gün sayısı; Pazar ve dini tatil hariç
7	Toplam gün sayısı; Cumartesi, Pazar ve resmi tatil hariç
8	Toplam gün sayısı; Pazar ve resmi tatil hariç
9	Toplam gün sayısı; dini tatil hariç
10	Toplam gün sayısı; dini ve resmi tatil hariç

Aykırı Değerlere Yapılan İşlemler

Aykırı ya da uç değerler, veri kümesindeki diğer verilerin sahip olduğu davranışa aykırı bir davranış sergileyen verilerdir. Aykırı değerlerin mevsim ve takvim etkilerinden arındırma modellerine dahil edilmesi durumunda test ve tahmin sonuçları büyük ölçüde etkilenebilir. Bu nedenle ön-arındırmada aykırı değerler mevsim etkilerinden arındırma yazılımı tarafından güvenilir bir yaklaşımla otomatik olarak belirlenerek, verilerden geçici olarak ayıklanır, ayrıştırmadan sonra mevsim etkilerinden arındırılmış veriye tekrar eklenir.

Model Seçimi

Ön-arındırmada kullanılacak ARIMA modelleri, birçok teşhis (diagnostic) istatistikleri dikkate alınarak ve aynı zamanda cimrilik kriteri (az parametre) kullanarak belirlenir.

Ayrıştırma Modeli

Ayrıştırma modelinin tipi, veriyi oluşturan çeşitli bileşenlerin (temel olarak trend-konjonktür, mevsimsel ve düzensiz bileşenler) ham veriyi oluşturmak üzere nasıl bir araya geldiğini belirler ve buna göre ayrıştırır. Ayrıştırma işlemi için toplamsal ya da çarpımsal modeller kullanılmaktadır.

Mevsim Etkilerinden Arındırma Sürecinde Kullanılan ARIMA Modelleri

TGE'nin mevsim etkilerinden arındırma sürecinde kullanılan ARIMA modelleri Tablo 3'te sunulmuştur.

Tablo 3. Tüketici Güven Endeksleri ARIMA Modelleri

Seri Kodu	Seri Adı	Log Dönüşümü	Sabit Terim	ARIMA Modeli* (p,d,q)(P,D,Q)	Aykırı Değerler**
HANE_MADDI	Hananın maddi durumu (geçen 12 aylık döneme göre mevcut dönemde)	Hayır	Hayır	(0,1,0)(0,1,1)	55 AO
HANE_MADDI_BEK	Hananın maddi durum beklentisi (gelecek 12 aylık dönemde)				
GED	Genel ekonomik durum (geçen 12 aylık döneme göre mevcut dönemde)				
GED_BEK	Genel ekonomik durum beklentisi (gelecek 12 aylık dönemde)				
ISZ_BEK	İşsiz sayısı beklentisi (gelecek 12 aylık dönemde)				
YDTUK_HAR	Yarı-dayanıklı tüketim mallarına yönelik harcama yapma düşüncesi	Hayır	Hayır	(0,1,1)(0,1,1)	
DLT_UYG	Mevcut dönemin dayanıklı tüketim malı satın almak için uygunluğu				
DLTTUK_HAR	Dayanıklı tüketim mallarına yönelik harcama yapma düşüncesi (geçen 12 aylık döneme göre gelecek 12 aylık dönemde)				
TAS_UYG	Mevcut dönemin tasarruf etmek için uygunluğu				
HANE_MALI	Hananın içinde bulunduğu mali durum	Hayır	Evet	(1,0,0)(0,1,1)	
TAS_BEK	Tasarruf etme ihtimali (gelecek 12 aylık dönemde)	Hayır	Hayır	(1,0,0)(0,1,1)	
BORC_BEK	Tüketimin finansmanı amacıyla borç kullanma ihtimali (gelecek 3 aylık dönemde)				
TUFE_DUS	Tüketici fiyatlarının değişimine ilişkin düşünce (geçen 12 aylık dönemde)	Hayır	Evet	(2,1,0)(0,0,1)	4 AO, 41 AO
TUFE_BEK	Tüketici fiyatlarının değişimine ilişkin beklenti (geçen 12 aylık döneme göre gelecek 12 aylık dönemde)				
UCR_BEK	Ücretlerin değişimine ilişkin beklenti (geçen 12 aylık döneme göre gelecek 12 aylık dönemde)	Hayır	Hayır	(0,1,1)(0,1,1)	47 TC
OTO	Otomobil satın alma ihtimali (gelecek 12 aylık dönemde)				
KONUT_TAMIR	Konut tamiratına para harcama ihtimali (gelecek 12 aylık dönemde)	Hayır	Hayır	(0,1,1)(0,1,1)	
KONUT	Konut satın alma veya inşa ettirme ihtimali (gelecek 12 aylık dönemde)	Hayır	Evet	(1,0,1)(0,1,1)	

Not. Modeller 2012 Ocak – 2018 Aralık dönemine ilişkin 84 gözlem kullanılarak tahmin edilmiştir.

(*) Tabloda p, standart AR (Otoregresif); P, mevsimsel AR; q, standart MA (Hareketli ortalama); Q, mevsimsel MA polinomunun derecesini; d ve D sırasıyla kaçınıcı dereceden düzenli ve mevsimsel farkların alındığını göstermektedir.

(**) AO, toplamsal aykırı değeri; LS, seviye kaymasını; TC, geçici değişimi temsil etmektedir. Aykırı değerlerden önceki rakamlar ise aykırı değerlin kaçınıcı gözlemde olduğunu göstermektedir.

MEVSİM ETKİLERİNDEN ARINDIRMANIN ÖZELLİKLERİ

Mevsim Etkilerinden Arındırma Yaklaşımının Seçimi

TGE'nin mevsim etkilerinden arındırılması işlemi, TRAMO-SEATS (Gomez ve Maravall, 1996) yöntemi ile gerçekleştirilmektedir. Kullanılan yöntem, Avrupa Birliği İstatistik Ofisi'nin tavsiyeleri çerçevesinde belirlenmiştir.¹ 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+ yazılımı kullanılmaktadır (Grudkowska, 2017).

Ham ve Mevsim Etkilerinden Arındırılmış Veriler Arasında Tutarlılık

Mevsim etkilerinden arındırılmış verilerin yıllık toplamı ile ham verilerin yıllık toplamı eşit olmayabilir. Bu durum, Avrupa Birliği İstatistik Ofisi'nin tavsiyelerine uygundur.

Mevsim Etkilerinden Arındırılmış Verilerde Toplulaştırılma Süreci

TGE için mevsim etkilerinden arındırılmış veri, mevsim etkilerinden arındırılmış alt endekslerin toplulaştırılmasıyla elde edildiğinden, toplulaştırılmış veriler ile alt endeksler arasında tutarlılık (toplamsallık ilişkisi) sağlanmaktadır.

Doğrudan Yaklaşım Karşı Dolaylı Yaklaşım

Bir veri iki ya da daha fazla alt bileşenin toplamından (genellikle ağırlıklı toplamından) oluşabilir. Alt bileşenlerin toplulaştırılmasıyla elde edilmiş verinin mevsim ve takvim etkilerinden arındırılması konusunda iki temel yaklaşım kullanılmaktadır. Bunlar doğrudan ve dolaylı yaklaşımlardır. Doğrudan yaklaşımda, toplulaştırılmış veri için ayrı ve alt bileşenleri için ayrı mevsim ve takvim etkilerinden arındırma işlemi yapılır. Dolaylı yaklaşımda ise önce alt bileşenler mevsim ve takvim etkilerinden arındırılır. Daha sonra, arındırılmış veriler toplulaştırılarak mevsim ve takvim etkilerinden arındırılmış toplulaştırılmış veriler elde edilir.

TGE'nin mevsim etkisinden arındırılmasında dolaylı yaklaşım benimsenmiştir.

¹ <http://ec.europa.eu/eurostat/documents/3859598/6830795/KS-GQ-15-001-EN-N.pdf>

Mevsim Etkilerinden Arındırma Modeli ve Arındırma Faktörlerini Tahmin Etme Vizyonu

TGE'nin mevsim etkisinden arındırma süreci, her yılın sonunda bir sonraki yılın model, takvim etkisi ve aykırı değer kompozisyonunun belirlenmesi ile başlamaktadır. Belirlenen bu kompozisyon sabit tutularak, yıl boyunca her yayım dönemi için model parametreleri ve filtreler yeniden tahmin edilmektedir. Dolayısıyla mevsim ve takvim etkilerinden arındırma için kullanılan faktörler her dönem için yeniden belirlenmektedir.

REVİZYON POLİTİKALARI

Mevsim etkilerinden arındırılmış veride; her dönem model parametrelerinin ve filtrelerin yeniden tahmin edilmesinden dolayı geriye dönük tüm veride revizyon meydana gelmektedir.

Genel Revizyon Politikası

Mevsim etkilerinden arındırılmış veri, iyi tanımlanmış ve kamuoyuna açık bir revizyon politikası ve yayımlama takvimine uygun olarak revize edilmektedir.

Özel Revizyon Politikası

TGE'de "kısmi eşzamanlı" mevsimsellikten arındırma yapılmaktadır. Mevsimsellikten arındırma modelleri, aykırı değerler ve takvim etkileri yıllık olarak belirlenirken; parametreler ve filtreler her dönem yeni veri eklendikçe yeniden tahmin edilmektedir. TGE için veriler geçmişe dönük revize edilmemektedir.

Yayımlanan Revizyonlar İçin Vizyon

Mevsim etkilerinden arındırılmış veriler, Avrupa Birliği İstatistik Ofisi'nin tavsiyelerine uygun olarak, cari yıl ve önceki üç yıl revize edilerek yayımlanmaktadır. Ancak TGE için farklı olarak; veriler geçmişe dönük revize edilmemektedir.

MEVSİM ETKİLERİNDEN ARINDIRMANIN KALİTESİ

Mevsim Etkilerinden Arındırılmış Verinin Kalitesinin Değerlendirilmesi

Mevsim Etkilerinden Arındırılmanın kalitesi, yıllık model belirleme aşamasında ve her dönem yürütülen arındırma süreçlerinde, standart teşhis istatistikleriyle ölçülmektedir.

Mevsim Etkilerinden Arındırılma için Kalite Ölçütleri

Seçilmiş bir teşhis seti (önsel mevsimsel testler, otokorelasyon ve mevsimsel otokorelasyon, çarpıklık ve basıklık gibi normallik ölçütleri, spektrum analizleri) ve gelişmiş görsel araçlar kullanılmaktadır.

MEVSİM VE TAKVİM ETKİLERİNDEN ARINDIRMA ÜZERİNE ÖZEL KONULAR

Az Gözlem Sayısına Sahip Verilerin Mevsim Etkisinden Arındırılması

Tüm veriler, mevsim etkisinden arındırılmaya yeterli uzunlukta gözlem sayısına sahiptir.

Sorunlu Verilerin İşlenmesi

Teşhis istatistikleri açısından sorunlu olan veriler özel şekilde işlem görmektedir. Geriye kalan veriler normal süreçlere tabi tutulmaktadır.

MEVSİM VE TAKVİM ETKİLERİNDEN ARINDIRILMIŞ VERİNİN SUNUMUNA İLİŞKİN KONULAR

Veri mevcudiyeti

Ham ve mevsim etkilerinden arındırılmış veriler mevcuttur.

Haber Bültenleri

Ham veriye ek olarak, mevsim etkilerinden arındırılmış veriler yayımlanır. Ayrıca, ham veri için düzey değerleri, diğer veriler için düzey değerleri ve değişim oranları yayımlanır.

REFERANSLAR

Grudkowska, S., (2017), “JDemetra+ Reference Manual Version 2.2”, Narodowy Bank Polski, Department of Statistics

https://ec.europa.eu/eurostat/cros/system/files/jdemetra_reference_manual_version_2.2_0.pdf

ESS Guidelines on Seasonal Adjustment.

<http://ec.europa.eu/eurostat/documents/3859598/6830795/KS-GQ-15-001-EN-N.pdf>

Gomez, V. ve Maravall, A., (1996), “Programs TRAMO (Time series Regression with Arima noise, Missing observations and Outliers) and SEATS (Signal Extraction in Arima Time Series) Instructions for the User”, Documento de Trabajo 9628, Servicios de Estudios, Banco de Espana.

http://www.bde.es/f/webbde/SES/servicio/software/tramo/Aut_Mod_Meth.pdf

<http://www.bde.es/f/webbde/SES/servicio/software/tramo/sasex.pdf>