

Türkiye’de Krizlerin Makroekonomik Değişkenlere Etkileri: VAR Analizi

Özet

Dünyada bilgi ve iletişim teknolojilerinde yaşanan gelişmeler ve gerçekleştirilen ekonomik entegrasyonlara paralel olarak, ülkelerin birinde meydana gelen bir ekonomik kriz, kısa sürede diğer ülkelere de yayılmaktadır. Türkiye ekonomisi için 1980 sonrası, dışa açılma ve ekonomiyi liberalleştirme dönemi olmuştur. Fakat aynı dönemde, gerek ülke içi dinamiklerden kaynaklanan, gerekse dış ülkelerde çıkıp Türkiye’yi de etkisi altına alan pek çok krizle de uğraşmak zorunda kalmıştır. Bu krizler, ülkedeki makroekonomik değişkenleri derinden ve uzun süreli etkilemiştir.

Abdullah ÖZDEMİR¹
İsmet GÖÇER²

Bu çalışmada; ekonomik krizlerin Türkiye ekonomisinin başlıca makroekonomik değişkenler üzerindeki etkileri, 1988–2011 dönemi aylık verileriyle, Granger nedensellik testi ve VAR yöntemiyle analiz edilmiştir. Yapılan analiz sonucunda, değişkenlerden birinde meydana gelen şokun, diğer değişkenleri önemli ölçüde etkilediği ve şokların etkisinin ortalama iki yıl sürdüğü görülmüştür.

Anahtar Kelimeler: *Ekonomik Kriz, Makroekonomik Değişkenler, Türkiye.*

The Effects of Crises on Macroeconomic Variables in Turkey: VAR Analysis

Abstract

An economic crisis that takes place in one country spreads in the short time to others parallel with development in information and communication technologies and economic integrations in the world. After 1980 has been a period of opening up and economic liberalization process for Turkey’s economy. But in the same period, Turkey had to face with many economic crises that either arose from domestic dynamics or started in other countries but affected Turkey as well.

In this study, effects of economic crises, Turkey’s economy on the main macroeconomic variables, were analyzed by Granger causality test and VAR method by using the monthly data for period of 1988-2011. As a result of the analysis it has been seen that a shock which happens to one of the variables has influenced the others to a large scale and the effects lasted two years on average.

Keywords: *Economic Crisis, Growth, Macroeconomic Variables, Turkey.*

¹ Yrd.Doç.Dr., Adnan Menderes Üniversitesi Nazilli İİBF İktisat Bölümü Öğretim Üyesi, aozdemir@adu.edu.tr

² Okt, Adnan Menderes Üniversitesi Nazilli İİBF İktisat Bölümü Doktora Öğrencisi, igocer@adu.edu.tr