

粮油市场

与贸易及政策分析

秦富 杨艳涛 杨根全◎著

L

IANGYOU SHICHANG

YU MAOYI JI ZHENGCE FENXI



中国农业出版社

粮油市场与贸易及 政策分析

秦 富 杨艳涛 杨根全 著

中国 农业 出版 社

图书在版编目 (CIP) 数据

粮油市场与贸易及政策分析 / 秦富, 杨艳涛, 杨根全著. —北京: 中国农业出版社, 2011. 6

ISBN 978-7-109-15683-8

I. ①粮… II. ①秦…②杨…③杨… III. ①粮油工业-国际贸易-研究②粮油工业-产业政策-研究 IV.

①F407.82

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2011) 第 091384 号

中国农业出版社出版

(北京市朝阳区农展馆北路 2 号)

(邮政编码 100125)

责任编辑 周 珊 柯文武

中国农业出版社印刷厂印刷 新华书店北京发行所发行

2011 年 6 月第 1 版 2011 年 6 月北京第 1 次印刷

开本: 850mm×1168mm 1/32 印张: 6.25

字数: 155 千字 印数: 1~2 000 册

定价: 25.00 元

(凡本版图书出现印刷、装订错误, 请向出版社发行部调换)

本书得到农业部国际合作司、农业部农业贸易促进中心国际农业监测研究体系项目“世界粮油市场、贸易及产业政策”课题资助，特此感谢！

前 言

粮食问题是关系人民生活和经济发展的重大战略问题，粮价是“百价之基”，粮价的稳定是抑制通货膨胀压力的重要因素之一。近年来，在国际粮价大幅攀升的背景下，中国粮食价格保持相对稳定，彰显了中国政府粮食宏观调控政策的成效。在国际、国内两个市场日益交融的情况下，应对国际粮价的大幅波动，需要充分利用两个市场、两种资源，建立新型的合作竞争关系。做到知己知彼，对国内外的市场情况心中有数，才能掌握主动权。在这种形势下，对国际国内粮油市场进行长期持续的关注、分析，掌握国内外粮油市场变化形势，对合理调整中国粮食调控政策，保障粮食安全，提高农业国际竞争能力，及时引导生产经营者有效规避市场风险有积极意义，也是各级政府面临的一项十分紧迫的任务。

本书在农业部国际合作司、农业部农业贸易促进中心国际农业监测研究体系项目“世界粮油市场、贸易及产业政策”研究的基础上，紧紧围绕国际和国内两个市场，对粮油市场与贸易及产业政策进行深入分析。全书共分为十二章。第一章以供求理论和国际贸易理论阐述市场与贸易研究的理论基础；第二章全面概述近十年来世界与中国粮油市场的发展趋势与特征；第三至第九章分别对2010年小麦、稻米、玉米、大豆及大豆油、花生及花生油、油菜子及菜子油、棕榈仁及棕榈油的市场与贸易形势变化的特征及趋势进行深入研究；第十章运用计量模型的定量预测和影响因素的定性判断两种方法，对后期两个市场的走势进行了预测与展望；第十一章重点针对小麦、玉米和豆油三个品种，运用计量分析方法，对国内外粮油市场期货、现货市场价格的联动性及

价格传导机制进行实证研究；第十二章回顾 2010 年中国粮食市场调控政策的成效，分析目前粮油市场调控中面临的挑战与问题，提出中国粮油市场调控的对策及政策建议。

本书是集体研究的成果。全书由秦富负责总体设计、内容审核和最终定稿。杨艳涛负责全书的写作组织和系统修改。第一章由杨艳涛、秦富撰写；第二章由杨艳涛、杨根全、秦富撰写；第三至五章由杨艳涛撰写；第六至九章由杨根全撰写；第十至十一章由杨根全、杨艳涛撰写；第十二章由秦富、杨艳涛、杨根全撰写。在本书的研究过程中，得到了许多部门和专家的支持和帮助，在此深表感谢。

本书对于粮油市场贸易产业与政策制定部门、研究人员及相关实践者具有一定的参考价值，但由于作者水平有限，错误和疏漏在所难免，敬请广大读者不吝指正。

2011 年 5 月 8 日

目 录

前言

第一章 市场与贸易的理论基础	1
一、供求理论	1
二、国际贸易理论	4
第二章 粮油市场发展概述	7
一、世界粮油市场发展	7
二、中国粮油市场发展	16
第三章 2010 年小麦市场与贸易分析	27
一、世界小麦市场	27
二、中国小麦市场	32
三、国内外小麦价格对比	35
四、影响国内小麦市场变化的因素分析	36
第四章 2010 年稻米市场与贸易分析	39
一、世界稻米市场	39
二、中国稻米市场	43
三、国内外大米价格对比	47
四、影响国内稻米市场变化的因素分析	48
第五章 2010 年玉米市场与贸易分析	50
一、世界玉米市场	50
二、中国玉米市场	55

三、国内外玉米市场价格对比	58
四、影响国内玉米市场变化的因素分析	59
第六章 2010 年大豆及大豆油市场与贸易分析	61
一、世界大豆和大豆油市场	61
二、中国大豆和豆油市场	71
三、影响国内豆油价格的主要因素分析	88
第七章 2010 年花生及花生油市场与贸易分析	89
一、世界花生及花生油市场	89
二、中国花生及花生油市场	93
三、影响国内花生油价格的主要因素	95
第八章 2010 年油菜子及菜子油市场与贸易分析	96
一、世界油菜子及菜子油市场	96
二、中国油菜子及菜子油市场	101
三、影响国内菜子油价格的主要因素分析	104
第九章 2010 年棕榈仁及棕榈油市场与贸易分析	106
一、世界棕榈仁及棕榈油市场	106
二、中国棕榈油市场	108
三、国内棕榈油价格影响因素分析	110
四、影响国内食用油市场变化的因素分析	111
第十章 粮油市场预测与展望	113
一、粮食市场预测与展望	113
二、食用油市场预测与展望	121
第十一章 国内外粮油市场价格联动性的实证分析	130
一、计量方法概述	130
二、国内外小麦市场价格联动性的实证研究	134

目 录

三、国内外玉米市场价格联动性的实证研究	148
四、国内外豆油市场价格联动性的实证研究	161
第十二章 中国粮油市场调控的对策及政策建议	176
一、2010 年中国粮食市场调控政策回顾	176
二、中国粮油市场调控面临的挑战与问题	179
三、中国粮油市场调控的对策及政策建议	184
 参考文献	 189

第一章 市场与贸易的理论基础

一、供求理论

(一) 均衡价格

价格机制是市场机制的核心，市场价格主要由供求关系决定。当商品供过于求时，商品价格下降，造成需求增加而产量降低；当商品供不应求时，则会推动价格上升，从而导致产量增加而需求减少。价格与供求关系之间这种相互影响和作用的结果就会使市场达到均衡状态，并存在一个理论上的均衡价格。均衡价格是西方经济理论中的一个核心概念，是指“在需求量和供给量相等的价格水平上，市场达到均衡。在均衡点上，价格既没有上升，也没有下降的趋势。均衡价格也称为市场出清价格”（萨缪尔森，1990）。均衡价格如图 1-1 所示。均衡价格是一种相对稳定的状态，一旦影响供给或需求的因素发生变化，原来的均衡就

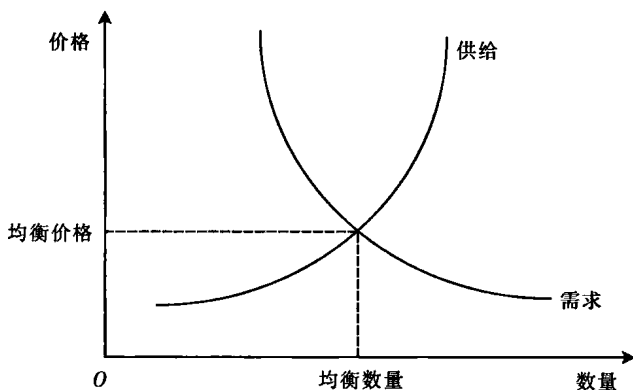


图 1-1 市场均衡价格示意图

会被打破，按照供求定律，价格会重新进行调整，从而达到一个新的均衡价格。由于影响供求的各种因素总是在不断的变化中，因此均衡价格也在发生相应的变化，表现出价格的波动性。均衡价格只是一个纯粹的理论上的概念，它是一种理想状态下的结果。在现实经济中，市场价格表现出明显的动态变化，不断有新的价格产生。

(二) 蛛网理论

蛛网理论是 20 世纪 30 年代西方经济学界出现的一种动态均衡分析，它将市场均衡理论与弹性理论结合起来，再引进时间因素来考察市场价格和产量的变动状况，即用供求定理解释某些生产周期长的商品，在供求不平衡时所发生的价格和产量循环影响的变动。蛛网理论研究的主要产品，从生产到上市都需要较长的生产周期，而且生产规模一旦确定，在生产过程未完成前，不能中途改变，因此市场价格的变动只能影响下一周期的产量。同时认为本期的产量取决于上一期的价格，本期的价格决定下期的产量。这种变动状况分为三种模型：

1. 收敛型蛛网模型。供给弹性小于需求弹性。意味着价格变动对供给量的影响小于对需求量的影响，这时价格和产量的波动会逐渐减小，使市场价格趋于均衡价格，称为“收敛型蛛网”（图 1-2）。

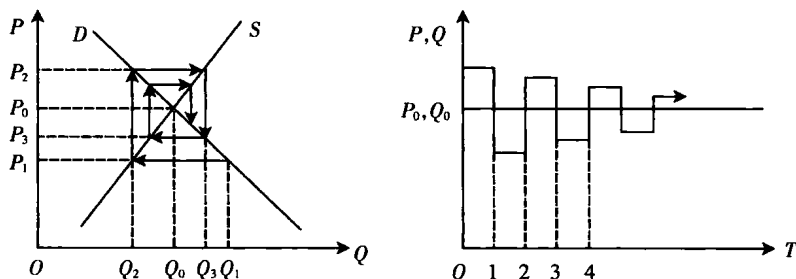


图 1-2 收敛型蛛网示意图

2. 发散型蛛网模型。供给价格弹性大于需求价格弹性。市场受外力干扰偏离均衡状态的市场价格在对下期供给量变动影响下，使实际价格和实际产量上下波动的幅度会越来越大，远离均衡点，使均衡无法恢复，这种情形称为“发散型蛛网”（图 1-3）。

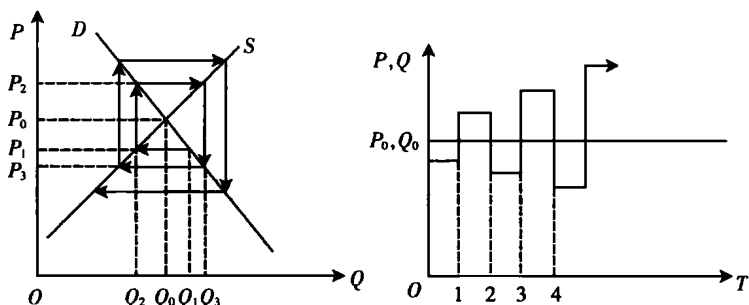


图 1-3 发散型蛛网示意图

3. 封闭型蛛网模型。供给弹性等于需求弹性。即价格波动引起供给量变动的程度始终不变，即实际产量和实际价格始终围绕均衡点上下波动，永远达不到均衡，称为“封闭型蛛网”（图 1-4）。

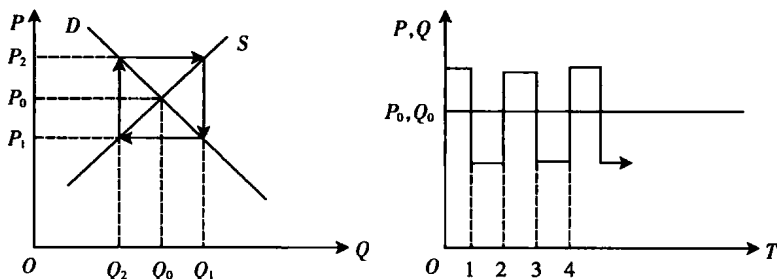


图 1-4 封闭型蛛网示意图

（三）基于蛛网理论的粮食价格波动分析

由于中国粮食需求价格弹性的绝对值小于 1，而粮食供给价格弹性的绝对值大于 1（邵鲁，2009），所以中国粮食需求价格

弹性小于粮食供给价格弹性。这样一来，中国粮食市场的自我调节趋势必然呈现出发散型蛛网波动，一旦粮食市场出现供求不平衡状态，靠市场机制的自发作用是不能重新回到均衡状态的。如果这种情况一直持续下去就会损害种粮农民和粮食消费者的利益，国家在粮食市场处于失衡状态的时候应该主动通过吞吐粮食储备和调整相关粮食价格等政策手段来调节市场供求关系、稳定粮食价格，进而保障整个国家的粮食安全。这就为国家制定粮食市场干预政策提供了理论依据。

二、国际贸易理论

（一）比较优势理论的发展

国家间为什么要进行贸易以及何时进行贸易？1776年亚当·斯密（Adam Smith）提出了绝对利益理论。斯密认为：如果一个国家比其他国家更廉价地生产某种产品，这个国家对该种产品的生产就有绝对利益。一个国家应该生产有绝对利益的产品，然后将其剩余产品出口，而进口那些其他国家以较低成本生产的产品。如果一个国家生产的所有产品都有绝对利益，那它就根本不用进行贸易。亚当·斯密的绝对利益理论于1817年受到大卫·李嘉图（David Ricardo）以及他的比较利益学的挑战。根据李嘉图的学说，即使一个国家生产的所有产品均有绝对成本优势，贸易动因仍然在。李嘉图认为分工可以使每个参与贸易的国家获得更多的财富。由斯密创立并由李嘉图发展的古典贸易理论给人们的启示是：国家间应自由地进行贸易。李嘉图以后的经济学家们不断地用放宽李嘉图理论中假设条件的方法来对李图模式进行发展。对李嘉图模式的最重要的发展要算赫克歇尔（E. F. Heckscher）和俄林（B. Ohlin）。赫克歇尔—俄林理论又被称为“要素禀赋论”。这一理论以两个先决条件为基础：一是产品依据其所需要的劳动和资本的多少而区别，即产品具有可区别的要素密集程度；二是国家依据其对劳动力和资本供给的不同而区别，

即国家具有可区分的要素充裕程度。根据赫克歇尔—俄林理论，一国应出口那些最适合生产的产品。资本供应的充裕表示一国在生产资本密集型产品方面具有比较利益。所以资本充裕的国家应该生产并出口资本密集型产品，而进口相对来说劳动密集型的产品。

（二）国家竞争优势理论与比较优势理论

迈克尔·波特在他的《国家竞争优势》中提出了一种新的理论范式即“国家竞争优势理论”。波特认为，一个国家的产业能否在国际市场上具有竞争力，取决于该国的国家竞争优势，而国家竞争优势是由四个基本因素——国内市场需求条件、相关产业与支持产业的活力、公司的战略、结构和竞争行为和两个辅助因素——政府行为和偶然事件相互作用所决定的。

虽然在经济分析中比较优势与竞争优势区别明显，但在实践中比较优势与竞争优势又是不可分割、密切联系的。从二者的区别与联系可知：一是拥有比较优势并不等于拥有竞争优势。比较优势是一种潜在的优势，往往表现为某一禀赋要素相对丰富，而竞争优势是一种实际显现的竞争能力，是生产力各构成要素综合协调的结果。二是比较优势与竞争优势可以相互转化。一国具有比较优势的产业往往易于形成较强的国际竞争优势。三是在各国产业发展中比较优势和竞争优势常常是相互依存的。一国产业的比较优势要通过竞争优势才能体现，即使具有比较优势的产业，如果缺乏国际竞争优势也无法实现其比较优势；反之，非常缺乏比较优势的产业通常也较难形成和保持国际竞争优势。

（三）中国农业国际贸易竞争力分析

应用比较优势理论对中国农产品的国际竞争力进行客观分析：长期以来国内种植业产品，尤其是粮食产品价格与国际相比不具备优势，而畜产品相对具有价格优势。用要素禀赋原理应当解释为：种植业生产首先与土地要素相联系，中国土地资源的稀缺性决定了种植业生产的局限性，供求关系决定了种植业产品相

对不具备比较优势；而欧美发达国家土地资源较为丰裕，特别是美国、加拿大、澳大利亚等国土地资源、气候条件都具有极大优势，因而相对具有比较优势。构成种植业产品比较优势的要素，除了土地资源外，还有其他要素，如劳动、资本、技术等，中国虽然劳动力资源丰富，但由于小农户的承包经营模式，劳动力成本反而高于经济发达国家。再加上发达国家在粮食作物生产上大量投入资本和技术，规模化经营，充分显示出“土地+资本+技术”的比较优势。

基于上述分析，提高中国农业国际竞争力，首先要树立面对两个市场、利用两种资源的观点，根据中国农业中不同产品相对比较优势的差异，适当增加进口种植业产品，即要素相对稀缺的产品，而扩大出口畜牧业、水产品以及蔬菜瓜果等具有相对优势的产品，因地制宜，加快农业产业结构调整。其次，要加快粮食市场的集约化、规模化的产业化进程，突破小农生产的经营方式，弥补由于土地要素的稀缺而带来的劣势。此外，还应加大对农业科技的投资力度，加快农业科技的研发和推广，增加资本和技术的比较优势。

第二章 粮油市场发展概述

一、世界粮油市场发展

(一) 粮食市场

1. 粮食产量波动较强。1946—1996 年的 50 年间,世界粮食年总产量由 5.33 亿吨增长到 20.50 亿吨,增长了 2.9 倍,而且其增长速度超过世界人口增长速度。从 20 世纪 90 年代来看,1990—1994 年粮食总产为 18.8 亿~19.6 亿吨,1995 年突破 20 亿吨大关,而在 1997 年,全世界粮食总产量达到 20.96 亿吨,创历史上最高点。但随后几年,粮食年总产量虽隔一两年有增有减,但始终在 20.5 亿吨左右徘徊,并呈逐年下降趋势。进入 21 世纪以来,世界粮食总产量呈逐年上升趋势(如图 2-1),但 2010/2011 年度由于极端天气使得世界粮食减产,主要是小麦减产。根据美国农业部 2011 年 1 月预测,2010/2011 年度全球粮食产量达到 21.81 亿吨,比上一年度减少 2.2%。其中,预计小麦产量 6.46 亿吨,比上一年度减少 5.4%;大米产量 4.52 亿吨,比上一年度增加 2.6%;粗粮产量 10.83 亿吨,比上年减少 2.2%。

2. 粮食消费量不断增长。据联合国的预测,到 2050 年全球人口数量将超过 90 亿,比当前新增 23 亿人口,新增人口相当于 1950 年全球人口总和。随着全球人口继续增长、生活水平不断提高,对粮食的食用和饲用需求将继续稳定增长;能源价格高企,出于能源安全考虑和环境保护考虑,食品能源化还将继续,将消耗大量粮食;随着技术进步和人类需求的多样化,粮食的工业需求将依然快速增长。如图 2-2,近几年全球三大粮食总消

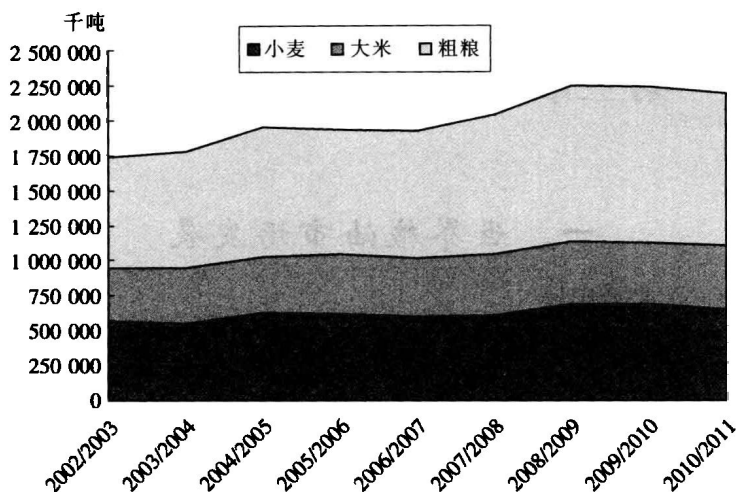


图 2-1 世界粮食产量变化

数据来源：美国农业部。

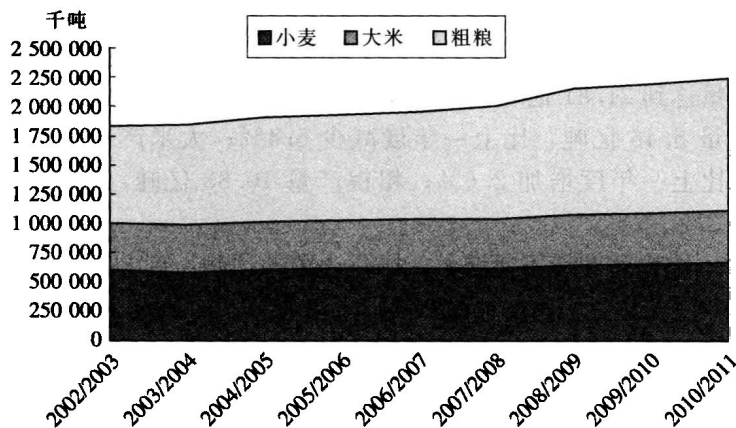


图 2-2 世界粮食消费量变化

数据来源：美国农业部。