



经济管理学术文库·管理类

市场化、国际化趋势下 中国粮食市场调控绩效研究

Research on the Performance of China's Grain
Market Regulation under the Trend of
Marketization and Internationalization

李光泗 / 著



经济管理出版社
ECONOMY & MANAGEMENT PUBLISHING HOUSE



经济管理学术文库·管理类

市场化、国际化趋势下 中国粮食市场调控绩效研究

Research on the Performance of China's Grain
Market Regulation under the Trend of
Marketization and Internationalization

李光泗 / 著



经济管理出版社
ECONOMY & MANAGEMENT PUBLISHING HOUSE

图书在版编目 (CIP) 数据

市场化、国际化趋势下中国粮食市场调控绩效研究/李光泗著. —北京: 经济管理出版社, 2015. 12

ISBN 978 - 7 - 5096 - 4180 - 4

I. ①市… II. ①李… III. ①粮食市场—宏观经济调控—经济绩效—研究—中国
IV. ①F724. 721

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2015)第 312252 号

组稿编辑: 曹 靖

责任编辑: 张巧梅

责任印制: 黄章平

责任校对: 雨 千

出版发行: 经济管理出版社

(北京市海淀区北蜂窝 8 号中雅大厦 A 座 11 层 100038)

网 址: www.E-mp.com.cn

电 话: (010) 51915602

印 刷: 北京九州迅驰传媒文化有限公司

经 销: 新华书店

开 本: 720mm × 1000mm/16

印 张: 12.25

字 数: 220 千字

版 次: 2016 年 4 月第 1 版 2016 年 4 月第 1 次印刷

书 号: ISBN 978 - 7 - 5096 - 4180 - 4

定 价: 58.00 元

· 版权所有 翻印必究 ·

凡购本社图书, 如有印装错误, 由本社读者服务部负责调换。

联系地址: 北京阜外月坛北小街 2 号

电话: (010) 68022974 邮编: 100836

资助项目

粮食公益性行业科研专项项目（201313009、201513004）

国家自然科学基金青年科学基金项目（71203087）

现代粮食流通与安全协同创新中心

江苏高校优势学科建设工程资助项目

江苏省高校哲社重点研究基地项目

江苏省“青蓝工程”资助计划项目

南京财经大学粮食安全与战略研究中心招标项目

江苏省高校优秀中青年骨干教师和校长境外研修计划资助项目

前言

粮食安全是国民经济发展“基础的基础”，中央一号文件连续 13 年聚焦于“三农”问题，2016 年一号文件再次聚焦于农业问题。自改革开放以来，我国粮食市场经历了多次巨大波动，“谷贱伤农”、“米贵伤民”现象时有发生。综观经济发展历史，世界各国政府把稳定粮食市场作为经济发展的一项重要政策，尝试了各种措施以保障运行，包括储备收购、价格管控以及关税壁垒等。近年来，世界范围的粮食价格剧烈波动又引起人们对价格稳定政策的关注。2007 ~ 2008 年全球粮食价格危机，让我们更加清醒地认识到，市场范围的扩大以及外部粮食市场的复杂性，增加了认识和利用国际市场的难度。为稳定国内粮食生产、平抑粮食市场波动、保障国家粮食安全，我国逐渐建立了系统的粮食价格调控体系，这对稳定我国粮食生产、平抑粮食价格异常波动与保障国家粮食安全发挥了重要作用。

随着粮食市场化、国际化程度越来越高，粮食市场环境发生深刻变化，这对国家粮食市场调控提出了新的挑战。一是粮食进口快速增长，粮食市场开放程度日益提高。随着中国粮食市场开放程度提高与粮食进口规模的快速增长，国际粮食价格波动对中国粮食市场的影响也逐渐凸显，尤其是近年来国际粮食价格发生了过山车式的剧烈波动，国际粮食市场行情逐渐成为影响中国粮食市场波动的重要因素。二是全球经济一体化进程加快，国内外粮食价格相互影响增强。在开放经济环境下，保障国家粮食安全面临的重大难题是国际市场利用与风险防控的平衡，这需要清楚把握国内外粮食价格波动传递机制及传递效应。三是外资进入步伐加快，粮食市场结构发生了重大变化。随着粮食产业的市场化、国际化进程加快，我国粮食产业组织体系发生了深刻变化，这必将对粮食市场结构产生重大冲击，进而影响粮食安全。四是政府对粮食价格的调控效率受到外部约束日益增强。随着国内市场化改革进程加快以及经济形势的转变，粮食价格调控的约束逐渐增强，粮食价格调控面临的国内与国际经济环境约束日益复杂。

近年来，粮食系统各类事件尤其是贪腐事件频发，使得关于粮食市场调控问



题的讨论日益激烈,粮食调控体系存在的调控目标不清、调控机制的市场扭曲问题也日益凸显。而且,在对粮食市场真实状况缺乏有效判断的情况下,政府粮食市场调控可能会扭曲市场价格信息的传递效应。为此,本书紧紧围绕市场化、国际化形势下粮食市场调控绩效问题,深入研究粮食市场调控对粮食生产、粮食价格波动、国际粮食市场波动风险与粮食产业发展等的影响,定量分析我国粮食市场调控绩效与效率,分析粮食市场调控存在的问题与面临的挑战。主要研究结论包括如下几点:

第一,粮食生产价格支持政策对粮食生产的增产效果较弱。粮食价格变量对粮食生产产生了显著的正向影响,价格机制对粮食总产量、粮食平均产量均产生较强的调节作用。但是基于谷物数据的研究表明,没有证据表明价格支持政策对稻谷面积扩大有明显的激励作用,而且还存在较低的成本有效性。

第二,粮食价格波动具有较强的非对称性,粮食价格波动的调控能力较弱。我国粮食市场调控政策在稳定粮食市场、化解粮食价格波动等方面发挥了重要作用,粮食市场调控政策对粮食价格波动具有类似于稳定器的作用,其中粮食市场调控政策在平抑稻谷与小麦波动方面具有较强的作用,但在平抑玉米与大豆价格波动时效率相对较低。

第三,在市场化、国际化趋势下,粮食产业发展能力较弱、政策促进效果较弱。粮油工业市场集中度较低、市场竞争激烈,粮油企业投资、研发创新投入不足;粮油工业产业发展绩效与市场结构正相关,市场结构的优化改善了产业发展绩效,但产业发展绩效整体水平偏低。

第四,粮食期货市场规避粮食价格异常波动风险的效果较弱。以玉米期货价格数据为例,定量分析我国粮食期货市场的运行效率及风险规避功能。研究发现,我国玉米期货市场的波动都具有持续性,说明玉米期货市场具有价格聚集性特征。通过比较发现,金融危机冲击下的我国玉米期货市场的效率比前后两个时间段的市场效率高。金融危机后我国玉米期货价格波动持续时间较长,因为外部冲击对期货价格波动的持续时间较长。

第五,国际粮食价格波动对中国粮食市场的影响日益增强。随着中国粮食开放程度的增强,尤其是粮食进口规模的快速增长,国际粮食价格波动对中国粮食市场的影响引起了广泛关注。研究发现,国际粮食价格波动对中国粮食价格波动具有显著的外溢效应,粮食市场开放会强化国际粮食价格波动的溢出效应。对于开放进程中的玉米与大豆市场来说,国际玉米与大豆价格波动不仅对中国市场价格波动产生了显著的正向影响,而且具有显著的正向溢出效应。

第六,粮食价格调控政策改革面临着诸多约束。在不考虑制度成本条件下,粮食价格稳定政策能够使社会福利增加;但是粮食价格调控体系存在巨额制度成

本，制度成本将极大地改变粮食价格稳定政策的社会福利效应，甚至会导致社会福利的恶化、财政负担的加剧，只有有效降低制度成本才能实现社会福利增加；目标价格补贴政策能够节省大量的粮食储备及调控成本，较好弥补价格波动对生产者与消费者福利的影响，但是目标价格的厘定是否合适和价格补贴效率对社会福利水平具有重要影响。

目 录

第一章 绪论	1
第一节 研究背景与问题提出	1
第二节 研究综述	5
第三节 研究方案	11
第二章 粮食流通政策演变与市场调控体系	16
第一节 我国粮食流通体制改革历程	16
第二节 我国粮食市场调控政策体系	28
本章小结	42
第三章 粮食生产价格支持与粮食生产供给反应	43
第一节 粮食生产价格支持政策与粮食生产现状	43
第二节 粮食市场价格支持对粮食生产的影响	53
第三节 粮食市场价格调控与粮食市场供给反应	59
本章小结	65
第四章 粮食市场调控与粮食价格波动	67
第一节 市场化条件下粮食价格形成机制	67
第二节 我国粮食价格体系改革与粮食价格波动	76
第三节 粮食价格调控效果的实证检验	80
本章小结	89
第五章 粮食加工体系改革与粮食产业发展绩效	91
第一节 我国粮食产业改革历程	91



第二节 粮食产业改革与粮食市场结构变动	93
第三节 粮食产业改革与粮食产业发展绩效	99
本章小结	112
第六章 粮食期货市场发展与粮食价格风险防范	113
第一节 粮食期货市场发展状况	113
第二节 粮食期货市场波动特性分析	117
第三节 粮食期货市场的价格发现功能分析	126
第四节 粮食期货市场的风险规避功能分析	133
本章小结	138
第七章 粮食市场开放与国际粮食价格波动传递	139
第一节 粮食市场开放与国际粮食价格影响机制	139
第二节 研究方法 with 数据说明	143
第三节 实证分析	148
本章小结	154
第八章 粮食价格调控政策改革及可能影响	155
第一节 问题提出	155
第二节 不考虑制度成本条件的粮食价格稳定政策的福利效应	156
第三节 考虑制度成本条件的粮食价格稳定政策的社会福利效应	160
第四节 目标价格补贴政策的福利效果及可能存在的问题	164
本章小结	166
第九章 研究结论与政策建议	168
第一节 研究结论	168
第二节 政策建议	170
参考文献	176
后 记	186

第一章 绪论

第一节 研究背景与问题提出

粮食作为生活必需品，对于任何一个经济体都有极为重要的政治意义和经济意义。粮食价格的波动对于粮食安全尤为敏感，直接关系到政策的制定和执行的绩效，现阶段我国粮食市场面临着各种挑战。

一、粮食进口快速增长，粮食市场开放程度日益提高

近年来，我国粮食市场国际化进程日益提高，粮食进口规模快速增长。2001年以来，我国大豆、玉米和稻谷等主要粮食进口规模均出现了显著增长，大豆进口规模从2000年的1325万吨持续增长到2012年的6000万吨以上，玉米从2000年的净出口1048万吨持续增长到2012年净进口520万吨，稻谷进口规模从2000年的38.7万吨增长到2012年的200万吨，小麦进口规模从2000年的87.6万吨持续增长到2012年的368.9万吨。随着中国粮食市场开放程度的提高与粮食进口规模的快速增长，国际粮食价格波动对中国粮食市场的影响也逐渐凸显，尤其是近年来国际粮食价格发生了过山车式的剧烈波动，国际粮食市场行情逐渐成为影响中国粮食市场波动的重要因素。

二、全球经济一体化进程加快，国内外粮食价格相互影响增强

在开放经济环境下，保障国家粮食安全面临的重大难题是国际市场利用与风险防控的平衡，这需要清楚把握国内外粮食价格波动传递机制及传递效应。在粮食基本自给自足条件下，国际粮食价格的变化对中国粮食价格的影响很小；在粮食市场一体化趋势下，国际粮食价格的波动会通过各种传导途径传递到中国粮食



市场,并产生不利的冲击,进而影响到中国粮食安全。另外,中国粮食进口、价格波动也可能影响到国际粮食市场供需,从而影响国际粮食价格波动。学者们对粮食市场的开放主要持两种截然相反的态度:第一种观点是粮食市场应进一步开放,他们认为国际粮食价格普遍比国内粮食价格低,增加进口,降低生活成本,缓解我国某些粮食品种的供不应求的状况。第二种观点是我国粮食市场不应该开放,一旦开放,我国的“饭碗”就掌握在别人的手里,这对我国粮食安全是一个巨大的不利影响。

基于全球经济一体化下学者们对我国粮食市场开放的担忧,国际粮食价格波动有多少中国因素?国际粮食价格波动又对中国粮食价格波动产生了什么影响?在粮食市场开放程度不断加深的背景下,粮食价格波动的传导出现了何种新变化?对我国粮食市场造成什么样的新冲击?研究清楚这些对保障粮食安全具有重要意义。在这种情况下,政府对我国粮食价格调控效率是否有效?如果调控有效就不应该出现国际粮食价格波动与我国粮食价格波动的相互传导,反之则应该出现价格波动的传递效应。研究粮食价格波动传导对政府制定粮食价格政策具有一定的参考意义。

三、外资进入步伐加快,粮食市场结构发生了重大变化

近年来,以丰益国际、嘉吉、邦基、ADM 和路易达孚为代表的跨国粮商,正加速进入我国粮食产业。按照我国加入世贸组织的协议,外资企业进入国内粮食领域的过渡期已经结束,中国在实行关税减让、取消非关税壁垒的基础上,逐步取消外资进入的地域限制、数量限制和股权限制。外资已经从植物油脂工业向面粉工业、制米工业扩展,并以粮油加工为核心,不断拉伸产业链,覆盖了粮食产业的各个环节。伴随我国粮食流通体制市场化改革的快速推进和粮食市场开放进程加快,我国粮食产业组织体系发生了深刻变化:一是粮食产业组织的寡头垄断趋势日益增强,外资粮油企业对市场支配力、市场占有率和粮食价格影响力不断提高;二是粮食流通产业的企业间组织形态日益多样,超大型粮食企业的快速发展和中小粮食企业发展滞后的矛盾,使得我国粮食流通产业的组织形态极大地依附于大型粮食企业的发展,这制约着粮食流通产业的有效竞争,极大地影响粮食产业安全。伴随我国粮食市场国际化进程加快,外资加速进入对国内粮食产业发展产生了重大影响,众多学者展开了大量研究。从市场开放较早的油脂行业来看,外资大举进入中国油籽压榨加工领域,在油籽压榨能力已经大大超过实际需求的情况下还在猛烈扩张,目的是企图进一步垄断我国的油脂消费市场(丁声俊,2006)。当然,大豆加工企业的利益并不等同于国内豆农的利益,不能简单地采用排斥外资、保护内资的思路(姜长云,2012)。但是,从国内粮食产业竞



争力与产业发展来看, 外资加速进入对粮食产业发展的影响也不容忽视。陈贤银(2010)研究我国农业产业领域的外资并购的效应发现, 外资利用对我国农业产业结构效应不明显、农业产业技术溢出效应不明显等。外资的进入将使粮食流通领域的总体格局发生改变, 并可能导致粮价波动更加频繁, 对粮食产业的控制也在逐渐增强, 进而可能影响我国粮食产业安全(刘刚, 2008; 杨光焰, 2011; 蓝海涛, 2011)。在外资加速进入我国粮食产业的背景下, 应在主动利用外资中积极防范外资进入风险(陈明星, 2012)。随着粮食产业的市场化、国际化进程加快, 伴随外资进入过渡期的结束, 外资大规模进入粮食产业是必然趋势, 这必将对粮食市场结构产生巨大冲击, 进而影响粮食安全。

四、政府对粮食价格的调控效率受到外部约束日益增强

随着国内市场化改革进程加快以及经济形势的转变, 粮食价格调控的约束逐渐增强, 粮食价格调控面临的国内与国际经济环境约束日益复杂。一是国内经济和收入增长以及劳动力成本的飙升增加了农产品特别是粮食作物的生产成本(钟甫宁, 2016), 这使得以稳定粮食生产和农民收入为初衷的粮食价格调控面临着较强的“地板价”约束, 也使得粮食价格调控对粮食产量的影响相对偏弱(陈飞等, 2010)。二是农村劳动力流动性增强, 加快了农户角色分化程度, 可能加大粮食价格调控对粮食生产影响的难度。农村劳动力流动使得农民的非农就业行为也存在显著差异, 对农户的生产行为产生重要影响(Feder, 1980; Amy, 1995; 王阳等, 2010; 陆文聪、吴连翠, 2011; 王跃梅等, 2013)。三是粮食流通体系市场化改革进程加快, 加大了政策性粮食价格调控的难度。当前除粮食收储环节外, 粮食生产、粮食价格、粮食流通、粮食销售与粮食市场已经全面放开, 政府主要通过原粮投放调节粮食市场供给及价格波动, 在粮食市场出现异常的情况下, 粮食价格调控效果依赖于粮食企业的流通与贸易行为(毛学峰等, 2015)。四是粮食市场开放使得国内粮食市场整合程度日益提高, 国际粮食价格波动和粮食进口增加均对国内粮食市场产生了重要影响(吕捷、林宇洁, 2013; 高颖等, 2013; 肖小勇等, 2014), 若考虑中国粮食金融化属性增强的特性, 国外因素对国内粮食价格波动影响更强(祁华清等, 2015)。尤其在国内外粮食价格存在较大价格倒挂的形势下, 粮食价格调控实际面临着较强的“天花板价”约束。

在“托低平高”双向粮食价格调控政策的作用下, 粮食价格出现了极强的刚性。对农户来说, 粮食价格调控有利于促进农民形成合理的价格预期, 起到稳定粮食生产收入、保障粮食生产收益的作用。对粮食企业来说, “托低平高”式的价格调控可能会压缩粮食企业盈利空间, 从而对其经营行为存在较强的价格硬



性约束。对于粮食市场来说,在对粮食市场真实状况缺乏有效判断的情况下,政府粮食储备及调控可能会扭曲市场价格信息的传递效应,导致粮食价格发生剧烈波动的可能性增加(钟甫宁,2011)。从调控体系来看,我国粮食调控体系存在的调控目标不清、调控机制的市场扭曲问题也日益凸显,这可能会进一步弱化粮食价格调控效果(程国强、朱满德,2013)。

五、粮食市场调控体制存在的问题日益凸显

近年来,粮食系统各类事件尤其是贪腐事件的频发,使得关于粮食调控问题的讨论日益激烈。众多学者针对当前粮食调控体系存在的问题,提出应该改革粮食托市收购政策。总体来看,以中储粮成立为标志的中央垂直管理体制使中央政府直接掌握了大量的储备粮,增强了中央政府在发生重大粮食危机时调控的及时性与效率,在稳定粮食生产、平抑价格波动、化解国际粮食市场危机、保障国家粮食安全等方面发挥了巨大作用。但是,在粮食储备与监管没有真正实现分离的情况下,中央储备也存在与市场化背道而驰、储备规模过大、组织管理行政化加重、财政补贴剧增、政策与经营性矛盾加剧等问题^①。在缺乏有效监管的情况下,中储粮集运动员、裁判员于一身,制度性缺陷加大了储备系统内经营企业方式道德风险。据不完全统计,自中储粮成立至今,垂直管理体系下的中储粮系统工作人员,因违纪、贪腐等问题被查办的人员多达百余人,一些大案要案屡屡发生^②。为此,中央决定对中央储备粮管理体系进行重大改革。2013年,国家发改委下发《关于做好2013年秋粮收购工作的通知》,对中储粮进行分权,明确由国家粮食局、农发行、中储粮三家共同监管国家储备粮^③。这种分权将有利于厘清各方权责,从而提高粮食收储、保管的质量,这是在中储粮近年来发生严重贪腐案件之后,国家层面探索新粮食收购监管策略方法的具体实践^④。这也进一步凸显了我国当下粮食市场调控体系存在的制度性缺陷。

① 王彦方,国家粮食储备体系优化的理论及政策研究[D].西南财经大学硕士学位论文,2012.

② 中储粮连发贪腐案后被削权:一家主导收储模式打破企业观察报[N].<http://www.nbd.com.cn>,2013-12-24.

③ 中华人民共和国发改委.关于做好2013年秋粮收购工作的通知(发改电[2013]229号)[Z].
http://www.sdpc.gov.cn/zcfb/zcfbtz/2013tz/t20131115_566831.htm,2013-11-15.

④ 中储粮被分权:一家主导收储模式打破[N].企业观察报,2013-12-24.



第二节 研究综述

一、国外研究综述

关于粮食市场调控的研究要追溯到粮食价格剧烈波动的思考与研究,尤其是20世纪70年代发生的粮食价格剧烈波动,从那时起学界开始激烈讨论粮食价格波动的影响及防范问题,从而形成了一些粮食价格稳定的理论与政策的研究。从价格波动影响来看,价格波动对生产行为及生产收益的影响已经得到许多经典理论的充分论证,价格不确定可能导致企业减少劳动投入数量、增加劳动使用强度,以提高期望收入、规避价格风险(Baron, 1970; Sandmo, 1971; Schmitz等, 1981)。就价格稳定的影响来看,无论从该主题的研究历史还是从对发展中国家的重要性来看,粮食价格稳定计划的重要性是显而易见的,这方面的理论要追溯到 Waugh (1944)、Oi (1961) 和 Massel (1969) 等相关学者的研究,他们的研究为后来的大多数研究提供了重要的理论基础。Waugh - Oi - Massel 方法假定线性的需求与供给函数,需求与供给由市场当期价格、随机扰动项等因素决定,在非稳定的市场环境下稳定价格处于市场平均价格(World Bank, 1977)。针对该理论框架存在的一些不足,Newbery 和 Stiglitz (1979) 构架了局部价格均衡分析的一般框架,这可以用来解释需求与价格波动来源等简化假设的作用,阐述了价格稳定方案的内涵,并分析了供给反应如何对初始的影响做出调整,而且该研究发现如果供给者的风险偏好不同,那么供给反应也就存在巨大差异。

实际上,关于价格调控政策能否使得农业生产投入增加、改善农民福利是存在巨大争议的。价格稳定政策可能通过三种途径对农业生产者产生影响:一是价格稳定政策可以减少价格风险;二是价格稳定政策影响平均价格水平;三是价格稳定政策可能改变生产者的收入波动(Newbery 和 Stiglitz, 1981)。粮食价格支持将改变预期价格,包括平均价格水平和价格分布,从而影响生产者的生产决策及供给反应行为(Galtagher, 1978)。如果平均供给保持不变,生产者与消费者的收入的边际效用保持不变,那么价格稳定政策的收益能够弥补福利的损失。若不考虑成本因素,价格稳定政策是潜在的帕累托改进(Newbery 和 Stiglitz, 1981)。Oi (1961) 的研究显示,与固定价格水平相比,生产者在不同价格水平下的销售能够获利更多。然而, Samuelson (1972) 坚定地认为,“没有人为操作的均衡能够实现消费者与生产者共同福利改进”。争论在于任何竞争均衡都是帕累托有效



的,那么从一个均衡向另一个均衡的任何变动都将导致部分主体福利恶化。争论的另一个问题是,通常来说保持平均价格不变是不可行的,因为平均销售与平均供给通常是变动的,所以价格是不稳定的。由于收益与效用对价格是凸的,生产函数和效用按照惯例通常假定对数量是凹的,那么不稳定使得二者同时情况好转被证明是不可行的。所以,争论集中到两个假定方面:经济是竞争的、没有不稳定外生因素干扰。Newbery (1978)指出,在当前市场竞争不完全的情况下,使得价格非均衡导致每个人福利都改善是可能的。当然如果存在市场不稳定的外生干扰因素,那么价格稳定可能使得生产者与消费者的福利都恶化,而且更加应该引起注意的是,价格进一步波动可能使得两方面利用都得到改善(Newbery 和 Stiglitz, 1981)。

广泛认为,价格稳定政策作用效果可能存在较大约束,价格稳定政策也可能导致生产者与消费者状况都发生恶化,尤其是在考虑生产者价格风险偏好差异的情况下,价格稳定政策对不同农民的影响存在巨大差异(Newbery 和 Stiglitz, 1981)。在考虑市场风险的情况下,生产者的反应行为可能更加复杂(Newbery 和 Stiglitz, 1981)。Miranda 和 Helmberger (1988)分析了政府通过市场公开购买与出售行为进行的价格支持与价格稳定问题,利用包含私人部门存储、期望价格反应供给的理性预期模型分析了政府的价格调节行为对美国大豆市场的影响,并进行随机模拟,研究结果表明价格稳定方案能够减少长期价格波动,但是可能加大生产者收入波动。虽然价格波动对所有农民都会产生同比例的影响,但是价格波动对不同农民可能具有不同影响效果(David M. Newbery, 1989)。Atanu Saha (1994)构建了在考虑产量与价格风险条件下的两个季节模型,分析了农户生产、消费、劳动供给和库存决策等行为模型,这个模型结果有别于其他的农户生产模型,基于印度乡村面板数据的实证研究也支持该模型结论,也支持农户家庭决策的季节性问题,结果验证了忽略了风险或风险偏好会导致最优反应行为估计的严重偏差。Bellemare、Barrett 和 Just (2013)利用埃塞俄比亚农村居民的面板数据,实证分析价格稳定政策对农村居民的影响,结果发现价格稳定政策对农村居民具有净福利的效应,但是由于不同农民的价格风险偏好不同,影响效果存在一定差异。就粮食价格支持影响来看,大量的实证研究已经对其影响作了深入的讨论,研究结论存在一定差异,而且粮食价格支持政策的效果受到外界经济社会等因素影响较大(Paul Gallagher, 1978; Bruce Gardner, 1985; Rogers, 1991; Andrew P. Barklry, 1992; Harald Witzkeh, 1993; Robert Matheson, 1994; Rob Fraser, 1994; Ellis Frank, 1997; Kim Kwansoo, 2002; T. S. Jayne, 2006; Wiggins 和 Keats, 2010)。

就不同地区或不同粮食品种价格的相互影响研究来看,众多学者展开了研

究,但是得出的结论存在一定差异。Shively (1996) 通过建立 ARCH 模型研究了加纳的玉米价格波动,他将产量、汇率和过去的价格作为解释变量,研究发现价格波动存在波动聚类,往期高价格将导致现期价格的高波动,这一研究印证了关于理性预期的存销比 (Stock-to-uses Ratio) 理论。Balcombe (2011) 通过对世界不同农产品价格的时间序列进行研究,建立了时变随机参数模型 (Random Parameter Model with Time-varying), 结果表明农产品的价格波动会通过各种途径传导,如通过汇率、利率传递到不同市场,进而印证了不同市场间存在价格波动的溢出。对于不同市场间的价格波动传导的实证效应分析,国外学者主要研究相关市场间的波动溢出,如 Teresa 和 Jose (2013) 通过半参数回归分析玉米价格与生物乙醇价格波动,在美国,玉米是制造生物乙醇的原料,因此,玉米价格的波动会影响生物乙醇的市场价格,研究发现这两个市场存在明显的价格波动传导,且印证了存销比理论。Buguk、Hudson 和 Hanson (2003) 通过建立 EGARCH 模型分析了渔业与谷物价格之间的波动,因为谷物是生产鱼饲料的原料之一,这两个市场高度相关,结果表明这两个市场也存在明显的价格波动溢出关系。

二、国内研究综述

回顾粮食价格政策演变,我国粮食价格改革经历了一个较长的探索过程,每次粮食价格改革都是在考虑当时国民经济整体状况、粮食形势、种粮农民和城市消费者等众多综合因素下做出的慎重决策 (亢霞, 2010)。进入 21 世纪以来,中央政府实施了粮食最低收购价、临时收储、粮食直补、农资综合补贴、良种补贴、农机具购置补贴等强农惠农、补贴支持农业的政策措施 (程国强, 2012)。现阶段农业补贴政策的核心目标是保障粮食安全、确保主要农产品供给和促进农民增收,我国构建的以价格支持为基础、以直接补贴为主体的农业补贴政策框架体系,必须注重创新农业补贴支持机制,要积极探索建立重要农产品价格稳定机制等 (程国强, 2013)。2004 年粮食购销市场全面放开以来,我国逐步建立起了粮食价格基本由市场决定的机制,并辅以托市收购这一重要的价格支持政策和市场调控手段。随着国内外粮食市场形势的变化,我国粮价形成机制和相关政策的运行也面临着新的问题和挑战,市场机制发挥作用的空間日益受限 (陈林、方景新, 2015)。

从粮食价格形成机理来看,改革开放 30 多年时间里,我国经历了 4 次明显的粮食涨价 (粮食生产价格和零售价格同比大于 10%), 但是每次波动的成因不尽相同 (董志勇、王双进, 2013)。由于我国经济体制不完善,粮食市场发育不完全,市场供求、生产成本等内部因素和国内政策、国际市场传导等外部因素共同影响粮食价格波动 (王双进、李顺毅, 2013)。粮食价格不仅受到外界成本因



素推动,也受到国际粮食市场和市场预期等因素影响(罗锋、牛宝俊,2010)。李晖(2004)认为其与宏观经济周期密切相关,宏观经济起伏决定粮食价格波动,农产品价格波动过大对稳定粮食生产供给不利,并对低收入群体的基本生活影响较大。随着市场化趋势增强,“价格—主体—行为”的作用机理也逐渐显现,从而使得粮食价格预期机制对经营主体行为产生影响,也对粮食价格波动产生作用(龚芳、高帆,2012)。由于粮食价格上涨会给城镇低收入居民带来危害,因此,政府有对粮食价格进行宏观调控的必要,且其积极作用也非常明显(李晖,2004)。国家对粮食市场的干预,控制了国内粮价的上涨,政府的粮食价格调控政策在稳定国内粮食价格方面发挥了重要作用(黄季焜,2009)。从农户角度来看,21世纪以来的粮食生产价格形成机制中,市场粮价已经成为主导因素,种粮成本的影响则十分微弱;粮食生产价格对市场粮价、种粮成本的传导作用并不明显。粮食收购市场的价格传导机制不通畅,价格形成侧重流通领域而偏离生产领域等问题(星焱、李雪,2013)。钟甫宁(2011)通过研究我国粮食储备政策对粮食市场的影响发现虽然粮食储备具有稳定粮食价格波动的作用,但是“它也可能延缓市场价格的信号作用,把本来不严重的短缺倾向积累成更大的波动”。

就粮食市场调控政策对粮食生产影响的研究来看,众多学者进行了大量研究。价格因素对我国粮食生产具有重要影响(蒋乃华,1998),就当前实行的托市政策效果来看,我国最低收购价政策存在托市效应,最低收购价格通过引导粮农的价格预期从而对他们的粮食供给行为起导向作用,提高粮食最低收购价水平,可以有效保护粮农利益,调动农民粮食的生产积极性(王士海、李先德,2012;张爽,2013;张建杰,2013)。粮食最低收购价政策对农户收入与储粮行为具有重要影响,但是对不同类型农户的影响存在较大差异(张改清,2014)。部分学者在肯定最低收购价政策效果的同时,提出要合理确定定价标准(方鸿,2009),发挥其价格导向与“影子价格”的作用等(邹风羽等,2009),发挥政策传导的价格信息对粮食生产起着显著的正向调节和刺激作用(翁贞林,2010;刘克春,2010)。从政策粮食竞价销售对市场价格影响来看,王士海和李先德(2013)对小麦政策性粮食竞价销售政策的有效性进行了考察,研究发现,竞价销售的拍卖价格与现货价格和期货价格之间存在协整关系,可以利用拍卖价格来解释现货价格的变化,计划销售规模对小麦现货价格的影响很明显,而实际成交规模对小麦现货价格的影响却有限。这说明竞价拍卖政策本身具有的信号功能要大于实际的市场供给功能,小麦现货价格的变化却直接影响着实际成交规模的变化。

在国内粮食市场化改革和对外开放进程加快的形势下,粮食市场调控政策面临的限制日益增强。我国粮食宏观调控政策对于调动农民种粮积极性、促进粮食