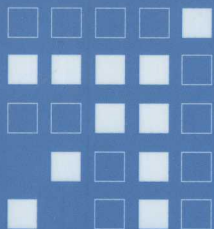
 传统农区工业化与社会转型丛书

丛书主编/耿明斋




中国农产品期货市场 发展路径研究

蔡胜勋 ◇ 著

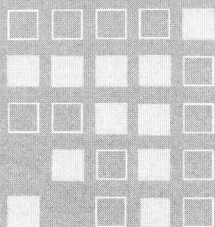
Research on Development
Path of China's Agricultural
Future Market



社会科学文献出版社
SOCIAL SCIENCES ACADEMIC PRESS (CHINA)

 传统农区工业化与社会转型丛书

丛书主编 / 耿明斋



中国农产品期货市场 发展路径研究

蔡胜勋 ◇ 著

Research on Development
Path of China's Agricultural Future
Market



社会科学文献出版社
SOCIAL SCIENCES ACADEMIC PRESS (CHINA)

图书在版编目(CIP)数据

中国农产品期货市场发展路径研究 / 蔡胜勋著 .

—北京: 社会科学文献出版社, 2016. 3

(传统农区工业化与社会转型丛书)

ISBN 978 - 7 - 5097 - 5827 - 4

I. ①中… II. ①蔡… III. ①农产品 - 期货市场 -
经济发展 - 研究 - 中国 IV. ①F832. 5

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2014) 第 058659 号

· 传统农区工业化与社会转型丛书 ·

中国农产品期货市场发展路径研究

著 者 / 蔡胜勋

出 版 人 / 谢寿光

项目统筹 / 邓泳红 桂 芳

责任编辑 / 桂 芳 陈晴钰

出 版 / 社会科学文献出版社·皮书出版分社(010)59367127

地址: 北京市北三环中路甲 29 号院华龙大厦 邮编: 100029

网址: www.ssap.com.cn

发 行 / 市场营销中心 (010) 59367081 59367018

印 装 / 三河市尚艺印装有限公司

规 格 / 开 本: 787mm × 1092mm 1/16

印 张: 15.75 字 数: 197 千字

版 次 / 2016 年 3 月第 1 版 2016 年 3 月第 1 次印刷

书 号 / ISBN 978 - 7 - 5097 - 5827 - 4

定 价 / 69.00 元

本书如有印装质量问题, 请与读者服务中心 (010 - 59367028) 联系

▲ 版权所有 翻印必究

如果不考虑以渔猎、采集为生的蒙昧状态，人类社会以 18 世纪下半叶英国产业革命为界，明显地可分为前后两个截然不同的阶段，即传统的农耕与乡村文明社会、现代的工业与城市文明社会。自那时起，由前一阶段向后一阶段的转换，或者说社会的现代化转型，已成为不可逆转的历史潮流。全世界几乎所有的国家和地区都曾经历或正在经历从传统农耕与乡村文明社会向现代工业与城市文明社会转型的过程。中国社会的现代化转型可以追溯到 19 世纪下半叶的洋务运动，然而，随后近百年的社会动荡严重阻滞了中国社会全面的现代化转型进程。

中国真正大规模和全面的社会转型以改革开放为起点，农区工业化潮流是最强大的推动力。正是珠三角、长三角广大农村地区工业的蓬勃发展，才将越来越广大的地区和越来越多的人口纳入工业和城市文明发展的轨道，并成就了我国“世界工厂”的美名。然而，农耕历史最久、农耕文化及社会结构积淀最深、地域面积最大、农村人口最集中的传统平原农区，却又是工业化发展

和社会转型最滞后的地区。显然，如果此类区域的工业化和社会转型问题不解决，整个中国的现代化转型就不可能完成。因此，传统平原农区的工业化及社会转型问题无疑是当前中国最迫切需要研究解决的重大问题之一。

使我们对传统农区工业化与社会转型问题产生巨大兴趣并促使我们将该问题锁定为长期研究对象的主要因素，有如下三点。

一是关于工业化和社会发展的认识。记得五年前，我们为申请教育部人文社科重点研究基地而准备一个有关农区工业化的课题论证时，一位权威专家就对农区工业化的提法提出了异议，说“农区就是要搞农业，农区的任务是锁定种植业的产业结构并实现农业的现代化，农区工业化是个悖论”。两年前我们组织博士论文开题论证时，又有专家提出了同样的问题。其实对这样的问题，我们自己早就专门著文讨论过，但是，一再提出的疑问还是迫使我们对此问题做更深入的思考。事实上，如前所述，从社会转型的源头上说，最初的工业都是从农业中长出来的，所以，最初的工业化都是农区工业化，包括18世纪英国的产业革命，这是其一。其二，中国20世纪80年代初开始的大规模工业化就是从农区开始的，所谓的苏南模式、温州模式不都是农区工业发展的模式么？现在已成珠三角核心工业区的东莞市30年前还是典型的农业大县，为什么现在尚未实现工业化的农区就不能搞工业化了呢？其三，也是最重要的，工业化是一个社会现代化的过程，而社会的核心是人，所以工业化的核心问题是人的现代化，一个区域只有经过工业化的洗礼，这个区域的人才能由传统向现代转化，你不允许传统农区搞工业化，那不就意味着你不允许此类地区的人进入现代人的序列么？这无论如何也是说不过去的。当然，我们也知道，那些反对农区搞工业化的专家是从产业的区域分工格局来讨论问题的，但是要知道，这样的区域分工格局要经过工业化的洗礼才

会形成，而不能通过阻止某一区域的工业化而人为地将其固化为某一特定产业区域类型。其四，反对农区工业化的人往往曲解了农区工业化的丰富内涵，似乎农区工业化就是在农田里建工厂。其实，农区工业化即使包含着在农区建工厂的内容，那也是指在更广大的农区的某些空间点上建工厂，并不意味着所有农田都要变成工厂，也就是说，农区工业化并不意味着一定会损害乃至替代农业的发展。农区工业化最重要的意义是将占人口比例最大的农民卷入社会主义现代化潮流。不能将传统农区农民这一占人口比例最大的群体排除在中国社会的现代化进程之外，这是我们关于工业化和社会发展的基本认识，也是我们高度重视传统农区工业化问题的基本原因之一。

二是对工业化发生及文明转换原因和秩序的认识。从全球的角度看，现代工业和社会转型的起点在英国。过去我们有一种主流的、被不断强化的认识，即中国社会历史发展的逻辑进程与其他地方——比如说欧洲应该是一样的，也要由封建社会进入资本主义社会，虽然某一社会发展阶段的时间起点不一定完全一致。于是就有了资本主义萌芽说，即中国早在明清乃至宋代就有了资本主义萌芽，且迟早要长出资本主义的大树。这种观点用另一种语言来表述就是：即使没有欧洲的影响，中国也会爆发产业革命，发展出现代工业体系。近年来，随着对该问题研究的深入，提出并试图回答类似“李约瑟之谜”的下述问题越来越让人们感兴趣，即在现代化开启之前的1000多年中，中国科学技术都走在世界前列，为什么现代化开启以来的最近500年，中国却远远落在了西方的后面？与工业革命联系起来，这个问题自然就转换为：为什么产业革命爆发于欧洲而不是中国？虽然讨论仍如火如荼，然而一个无可争议的事实是：中国的确没有爆发产业革命，中国的现代工业是由西方输入的，或者说是从西方学的。这一事实决定了中国工业化

的空间秩序必然从受西方工业文明影响最早的沿海地区逐渐向内陆地区推进，不管是 19 世纪下半叶洋务运动开启的旧的工业化，还是 20 世纪 80 年代开启的新一轮工业化，都不例外。现代工业诞生的基础和工业化在中国演变的这一空间秩序，意味着外来的现代工业生产方式和与此相应的经济社会结构在替代中国固有的传统农业生产方式和相应的经济社会结构的过程中，一定包含着前者对后者的改造和剧烈的冲突。而传统农耕文明历史最久、经济社会乃至文化结构积淀最深的传统农区，一定也是现代工业化难度最大、遇到障碍最多的区域。所以，将传统农区工业化进程作为研究对象，或许更容易发现两种不同文明结构的差异及冲突、改造、替代的本质和规律，从而使该项研究更具理论和思想价值。

三是对我们所处的研究工作环境和知识积累的认识。我们中的很多人都来自农民家庭，我自己甚至有一段当农民的经历，我们工作的河南省又是全国第一人口大省和第一农民大省，截至 2008 年末，其城市化率也才不到 40%，也就是说，在将近 1 亿人口中，有近 7000 万人是农民，所以，我们对农民、农业、农村的情况非常熟悉，研究农区问题，我们最容易获得第一手资料。同时，我们这些土生土长的农区人，对该区域的现代化进程最为关注，也有着最为强烈的社会责任感，因此，研究农区问题我们最有动力。还有，在众多的不断变化的热点经济社会问题吸引相当多有抱负的经济学人的情况下，对事关整个中国现代化进程的传统农区工业化和社会转型问题进行一些深入思考可能是我们的比较优势。

我个人将研究兴趣聚焦到农区工业化上来始于 20 世纪 90 年代中期，进入 21 世纪以来，该项研究占了我越来越多的精力和时间。随着实地调查机会的增多，进入视野的令人感兴趣的问题也越来越多。与该项研究相关的国家社科基金重点项目、一般项目以及教育部基地重大项目的相继立项，使研究的压力也越来越大。值

得欣慰的是，该项研究的意义越来越为更多的学者和博士生及博士后研究人员所认可，研究队伍也越来越大，展开的面也越来越宽，研究的问题也越来越深入和具体。尤其值得一提的是日本大学的村上直树教授，他以其丰厚的学识和先进的研究方法，将中国中原地区的工业化作为自己重要的研究方向，且已经取得了重要进展，并打算与我们长期合作，这给了我们很大的鼓舞。

总之，研究对象与研究领域已经初步锁定，研究队伍已聚集起来，课题研究平台在不断拓展，若干研究也有了相应的进展。今后，我们要做的是对相关的研究方向和研究课题做进一步的提炼，对研究队伍进行优化整合，对文献进行更系统的批判和梳理，做更多的实地调查，力争从多角度来回答若干重要问题，比如：在传统农业基础上工业化发生、发育的基础和条件是什么？工业化究竟能不能在传统农业的基础上内生？外部的因素对传统农区工业化的推进究竟起着什么样的作用？从创业者和企业的行为方式看，工业企业成长和空间演进的轨迹是怎样的？在工业化背景下，农户的行为方式会发生怎样的变化，这种变化对工业化进程又会产生怎样的影响？县、乡等基层政府在工业化进程中究竟应该扮演何种角色？人口流动的方向、方式和人口居住空间结构调整演进的基本趋势是什么？这是一系列颇具争议但又很有研讨价值的问题。我们将尝试弄清楚随着工业化的推进，传统农业和乡村文明的经济社会结构逐步被破坏、被改造、被替代，以及与现代工业和城市文明相适应的经济社会结构逐步形成的整个过程。

按照目前的打算，今后相当长一个时期内，我们的研究都不可能离开传统农区工业化与社会转型这一领域，我们也期望近期在若干主要专题上能有所突破，并取得相应的研究成果。为了将所有相关成果聚集到一起，以便让读者了解到我们所研究问题的全貌，我们决定编辑出版“传统农区工业化与社会转型丛书”。我

们希望，随着研究的推进，每年能拿出三到五本书的相关成果，经过3~5年，能形成十几乃至二十本书的丛书规模。

感谢原社会科学文献出版社总编辑邹东涛教授，感谢该社皮书出版分社的邓泳红，以及所有参与编辑该套丛书的人员，是他们敏锐的洞察力、强烈的社会责任感、极大的工作热情和一丝不苟的敬业精神，促成了该套丛书的迅速立项，并使出版工作得以顺利推进。

耿明斋

2009年6月14日

期货市场与农业有着很深的渊源，世界上最早的期货交易就起源于农产品，发达国家的经验表明，期货市场可以为农业发展保驾护航。中国自引入期货交易制度至今已有二十余年的时间，虽然其间经历了一些波折，但近年来中国期货市场尤其是农产品期货市场发展迅速，一些大宗农产品相继上市，市场交易规模不断扩大，市场功能得到初步发挥。但制约市场发展的深层障碍并没有得到根本突破。

商品的生产经营者应该成为市场的基本参与者，但中国农产品期货市场始终存在着生产者缺位的问题，即市场基本见不到作为生产者的农民的身影，农民也无法从这个市场的发展中获益。目前，该问题已经得到广泛重视，2010年的中央一号文件明确提出“鼓励生产经营者利用期货市场规避风险”。事实上，农民参与期货市场有多种途径：直接参与、通过“企业+农户”或“合作社+农户”方式间接参与等。农民直接参与期货市场要求农户具备较大的生产规模、雄厚的资金实力和相关知识等，而多数农户

并不具备这些条件，因此，即使在发达国家通过这种形式参与期货市场的农户也较少，多数农户是通过后两种方式间接参与期货市场的。

然而，由于我国的特殊国情，农民参与期货市场的几种途径均存在障碍。我国农业的一个重要特点是小规模分散经营，相关的中介组织不发达。小规模分散经营的特点使得我国农民几乎不可能直接参与期货市场。通过“企业+农户”的方式参与存在着交易费用高、企业与农户的地位不对等以及由此产生的一系列问题。因此，现实中农民通过“企业+农户”参与期货市场的成功案例并不多见。农民通过合作社参与期货市场在发达国家是比较常见的。虽然近年来中国的农民合作组织发展迅速，但依然存在规模小、资金实力弱、经营管理人才匮乏等情况，我国农民合作组织的这种状况使得其无法承担起组织农民参与期货市场的重任。而且，我国的农民合作组织的发展有着明显的产业差异，即多数集中在商品化程度较高的专用品种上，大宗农产品领域的农民合作组织相对较少，而期货市场交易的都是大宗农产品。上述因素使得我国农民通过合作社参与期货市场非常困难。

农产品期货市场生产者缺位的状况不仅使得其服务“三农”的能力大打折扣，而且也影响了其功能的正常发挥。期货市场作为一种高端市场要求相关的交易主体具备一些基本条件。我国农业的经营方式以小规模分散经营为主，而且相关的中介组织不发达，两者存在明显矛盾。从实践的角度出发，可以采取“企业+合作社+农民”的方式，由企业进入期货市场操作，合作社负责把农民组织起来，事实上合作社起着桥梁作用，企业减少了和大量小农户打交道的交易费用，而农户也由于合作社的介入取得了和企业相对对等的地位。在此过程中，合作社的实力逐渐壮大，等条件成熟后，由合作社直接组织农民参与期货市场。目前，中

国的一些地方已经做出了有益探索，出于农民规避经营风险、获得稳定利润的需要，经由这种方式，合作社把农民组织起来，实现我国农业经营方式的转变，而我国农产品期货市场由于获得了来自最基层同时也是最广泛的生产经营者的支持可以向更深层次发展。

关键词：期货市场；生产者缺位；农业经营方式；发展路径

Futures market has deep roots with agriculture, The world's first futures exchange was derived from agricultural products. Experience of developed countries has showed that the futures market can escort the development of agriculture. There is nearly two decades since the introduction of futures trading system in China, Although there is some ups and downs, China's futures market, especially the agricultural futures markets has been developed rapidly in recent years: a number of staple agricultural products listed, market transactions expanded, function played initially. But at the same time the underlying obstacles restricting development of market has not been fundamentally alleviated.

Producers of goods should be the basic participants in the market, however, there is always the question of producer absence in China's agricultural futures market, that there is no farmers in this market, farmers can not benefit from the development of this market. This problem has been taken seriously at present. The first document of the central govern-

ment in 2010 made it clear that “to encourage the producers using the futures market to avoid risk.” In fact, the farmers have a variety of ways to use futures markets: Direct participation, indirect participation through the “enterprise + farmer” or “cooperative + farmer”. Direct participation in futures market requires that farmers have a larger production scale; solid financial strength and a high level of knowledge, etc. While most farmers do not possess these conditions, Therefore, even in developed countries fewer farmers adopt the first form, most farmers are indirectly involved in the futures market with two other ways.

However, due to China’s special conditions, there are some obstacles for farmers to participate the futures market in these ways. An important feature of China’s agriculture is a small-scale decentralized management, the relevant intermediary organization developed. It is nearly impossible for our country’s small-scale farmers to directly involve in the futures market. The question of “enterprise + farmer” is high transaction costs; involved in the unequal status of enterprise and farmers, as well as a range of issues arising. Therefore, the farmers through the “enterprise + peasant household” are rare in the futures market in reality. Farmers through cooperatives in the futures market are more common abroad. Although in recent years, cooperative organizations of farmers have developed rapidly in China, these cooperative organizations are small, financial strength is weak, the managerial talent is extremely short. This situation of China’s Cooperation Organization of farmers makes it impossible to organize the farmers in the futures market. Moreover, there was a clear difference in the industry for China’s cooperative organizations of farmers, that is most concentrated in the higher levels commercialization of specific species, but rural cooperative organizations is relatively small in the field of the bulk of

agricultural products, it is the staple agricultural products in the futures market. Which make it is very difficult for our farmers to involve in the futures market through cooperation.

The absence agricultural producers in the futures market not only made the ability of the market serve “San Nong” greatly reduced, but also affected the normal functioning of the futures market. Futures market as a relatively high-end market requires related main body with some of the basic conditions. Mode of China’s agriculture is mainly based on small-scale decentralized operations, and the relevant intermediary organization developed, there is a clear contradiction in these two areas. From a practical point of view, we can take the approach of “enterprise + cooperative + farmer”, enterprises enter the futures market, the cooperative is responsible to organize farmers, where cooperatives play a bridge role, companies have reduced their transaction costs of dealing with small farmers through this way, farmers also have achieved a relatively equal status because of the involvement of cooperatives, the cooperative’s strength will gradually grow in this process, cooperative can organize farmers in the futures market while the conditions are ripe. At present, some parts of China have made a useful exploration. For the farmers to avoid the relevant operational risks and the need for a steady profit, Using this approach, farmers can organize themselves through co-operation to achieve the transformation of China’s agricultural mode of operation. Moreover, China’s agricultural futures markets could be at deeper level due to receive from the support of the lowest level is also the most extensive producers and managers.

Key words: Futures market; absence of producer; Forms of agriculture; Development Path

第一章 绪论	1
第一节 研究背景	1
第二节 研究意义和目的	6
第三节 研究内容	7
第二章 农产品期货市场的基本功能分析	11
第一节 农产品期货市场风险规避功能分析	11
第二节 农产品期货市场的价格发现功能分析	24
第三章 中国农产品期货市场的发展历程、现状及问题	41
第一节 中国农产品期货市场发展历程	41
第二节 中国农产品期货市场的现状	52
第三节 我国农产品期货市场存在的问题	61
第四章 农产品期货市场在促进农业发展中的作用分析	65
第一节 农产品期货市场在农业发展中的作用	65

第二节	期货市场在农业结构调整中的作用探析	76
第五章	制约中国农产品期货市场发展的深层原因分析	97
第一节	前言	97
第二节	农产品期货市场充分发展的条件分析	100
第三节	制约我国农产品期货市场发展的深层原因分析	104
第四节	结论及建议	112
第六章	中国农产品期货市场生产者缺位的经济学分析	115
第一节	前言	115
第二节	生产者利用期货市场的理论分析	117
第三节	农业生产者参与期货市场的路径分析	120
第四节	我国现有的农业经营方式导致农产品期货市场 生产者缺位	133
第五节	我国农民利用农产品期货市场的思考	136
第六节	结论及建议	139
第七章	中国大宗农产品领域农民合作经济组织发展的困境 ——农民参与农产品期货市场的路径探析	141
第一节	引言	141
第二节	相关文献回顾	143
第三节	中国农民合作经济组织产生与发展的产业差异的 理论分析	144
第四节	大宗农产品领域农民合作经济组织发育滞后的影响 因素分析	147
第五节	结论	155