

我国粮食价格 波动分析

汪迪棣 郑可心 朱莉 韩周瑜 著



四川大学出版社



责任编辑:唐 飞
责任校对:蒋 琦
封面设计:墨创文化
责任印制:王 炜

图书在版编目(CIP)数据

我国粮食价格波动分析 / 汪迪棣等著. —成都:
四川大学出版社, 2015. 7
ISBN 978-7-5614-8809-6
I. ①我… II. ①汪… III. ①粮食—物价波动—研究—中国 IV. ①F323.7②F724.721
中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2015) 第 171953 号

书名 我国粮食价格波动分析

著 者	汪迪棣 郑可心 朱 莉 韩周瑜
出 版	四川大学出版社
地 址	成都市一环路南一段 24 号 (610065)
发 行	四川大学出版社
书 号	ISBN 978-7-5614-8809-6
印 刷	四川永先数码印刷有限公司
成品尺寸	148 mm×210 mm
印 张	5.375
字 数	144 千字
版 次	2015 年 8 月第 1 版
印 次	2015 年 8 月第 1 次印刷
定 价	22.00 元

版权所有◆侵权必究

◆读者邮购本书,请与本社发行科联系。
电话:(028)85408408/(028)85401670/
(028)85408023 邮政编码:610065
◆本社图书如有印装质量问题,请
寄回出版社调换。
◆网址:<http://www.scup.cn>

前 言

粮食是人类生存和发展过程中不可或缺的战略资源。但由于世界粮食安全常常会受到一些长期存在的因素困扰，粮食的供给和需求与人口增长之间的矛盾已日益突出，各国政府和国际社会已经将粮食安全问题确定为高度关注的重大战略问题。改革开放以来，随着计划经济体制逐渐向市场经济体制转轨，我国已经逐步建立市场导向型的价格形成机制，影响粮食价格的因素也因此日益增多并复杂化，其波动越来越明显。粮食市场价格的波动给我国的粮食生产、粮食进出口和国家宏观经济调控带来了诸多不确定性。

本书主要通过研究我国粮食价格的波动状况，在丰富我国粮食经济理论的同时，为国家对粮食市场的有效调控提供有益的意见。本书分8章对粮食波动问题进行研究。第1章介绍了我国粮食价格波动的基本概况和研究此课题的意义以及相关概念的界定；第2章介绍了国内外关于粮食价格波动理论及相关文献综述；第3章介绍了我国粮食价格波动历史状况，以及波动的特点和影响；第4章介绍了后金融危机时代我国粮食价格波动的现状、当前粮食价格波动的新特点以及国际粮食价格波动与我国粮食价格波动的异同；第5章介绍了我国粮食价格体系及粮食市场，包括我国粮食价格形成机制、市场价格体系、市场供求历史与现状、粮食供求矛盾对粮食价格波动的影响；第6章是关于我

国粮食价格影响因素的分析；第7章介绍了粮食价格波动与我国经济安全的关系；第8章介绍了保证新时期粮食价格稳定和防止通货膨胀的政策措施。

本书系统汇总了我国粮食价格波动的历史和现状，并综合运用动态与静态、规范与实证等方法深入剖析了粮食价格波动的原因及其影响，同时给出了在新时期保证合理的粮食供应及我国的粮食经济安全的建议。

目 录

第 1 章 导论	(1)
1.1 研究背景和意义	(1)
1.2 相关概念界定	(7)
第 2 章 粮食价格波动理论及相关文献综述	(13)
2.1 波动的定义与度量	(13)
2.2 粮食价格波动成因理论	(17)
2.3 粮食价格波动的阶段性划分	(25)
2.4 宏观经济波动与农业波动的历史演变	(29)
2.5 粮食价格波动的传导机制与同步性	(36)
第 3 章 我国粮食价格波动的历史分析	(40)
3.1 我国粮食价格波动的阶段性划分	(40)
3.2 我国粮食价格波动的特点	(43)
3.3 粮食价格波动与经济波动的重叠与偏离	(48)
3.4 粮食价格波动对我国经济的影响	(54)
第 4 章 后金融危机时期我国粮食价格波动的现状分析	(62)
4.1 国际金融危机对全球粮食价格的影响	(62)
4.2 后金融危机时期粮食价格波动的阶段性特征	(68)
4.3 后金融危机时期粮食价格波动的新特点——全球性 通货膨胀	(71)
4.4 国际粮食价格波动与我国粮食价格波动的异同	(73)
第 5 章 我国粮食价格体系及粮食市场	(76)

5.1	我国粮食价格形成机制	(76)
5.2	我国粮食市场价格体系	(82)
5.3	我国粮食市场供求历史与现状	(88)
5.4	粮食供求矛盾对粮食价格波动的影响	(96)
第 6 章	我国粮食价格影响因素分析	(101)
6.1	自然因素	(102)
6.2	游资因素	(112)
6.3	金融因素	(115)
6.4	国际贸易因素	(119)
6.5	世界经济因素	(124)
第 7 章	粮食价格波动与我国经济安全	(125)
7.1	粮食的基础性作用与物价“稳定器”作用	(125)
7.2	粮食生产的不确定性与预期性	(128)
7.3	我国粮食安全体系构建	(132)
7.4	稳定粮食价格的经济手段	(137)
第 8 章	保证新时期粮食价格稳定和防止通货膨胀的政策措施	(144)
8.1	努力提高我国粮食综合生产能力, 构建内生供给保障	(145)
8.2	加强在全球化市场中构建中国粮食价格外围保障	(149)
8.3	完善期货市场的建设, 进行粮食价格投资管理	(152)
8.4	完善我国粮食市场价格机制, 从制度层面提供保障	(157)
参考文献		(162)

第1章 导论

1.1 研究背景和意义

1.1.1 研究背景

国际粮食价格由于受到供求、投机、政策、美元贬值等多方面影响，波动的频率和幅度逐渐加大，并且呈现波动上升的态势。2002年以来，粮食价格直线上升，主要是由于世界粮食减产，导致多数粮食价格回升；2003年上半年虽然有所回落，但由于自然灾害的影响，产量仍没有恢复到往年正常水平。2005年，全球玉米、小麦产量分别下降2.4%和1.3%，粮食总产量减少1.4%；同时，由于国际原油价格大幅攀升，玉米作为生产能源替代品的原料需求快速增加，拉动粮食需求旺盛，粮食库存比2001年大幅减少27%，价格开始爬升。2006年，世界粮食价格上涨迅速，2007年进一步攀高，比2006年上涨37%。其中小麦上涨63%，玉米上涨26.7%，大米上涨16.4%，油料依品种不同涨幅达60%~70%不等。自2005年11月以来，粮食价格经历了3次剧烈上涨，即2006年9月至11月、2007年4月至9月以及2007年10月，涨幅分别是28.2%、38.1%和44.2%。

世界粮食市场价格的上涨并不鲜见，但几乎所有粮食品种较长时期都持续涨价，历史罕有。

2008年，国际粮食价格创下近50多年来的历史最高纪录，引起全球性的粮食恐慌，包括埃及、海地、喀麦隆、朝鲜、印度尼西亚、乌兹别克斯坦在内的至少37个国家，发生与粮价有关的骚乱。海地2008年大米、大豆和水果的价格比去年上涨了50%，面食价格涨了1倍。2008年4月3日，海地的莱凯市最先发生暴力抗议，随后又蔓延至海地各大城市；8日大批抗议者在太子港总统府门前示威，要求总统普雷瓦尔下台。喀麦隆2008年2月因物价高涨发生暴动，导致40人死亡。2007年，朝鲜的粮食产量仅为300万吨，比前一年低了25%，650多万人的食粮得不到保障。世界银行警告说，由于粮食和能源价格达到6年来最高，墨西哥、也门等33个国家可能面临“社会动荡”。同时亚洲开发银行（Asian Development Bank, ADB）报告显示，粮食价格上涨50%将削减亚洲2008年实际GDP增幅1.05个百分点，并同样影响2009年经济增长^①。粮食问题成为次贷危机之后对全球经济的又一严重威胁。

从1960年以来的数据看，世界粮食库存并不稳定。同时国际粮食供需缺口也在日益加大，世界粮食产量在近8年中有7年低于消费量，供求缺口只能由库存弥补，导致粮食库存降至历史新低。衡量粮食安全的储存—消费比率，2006/2007年度为20.7%，2007/2008年度为19.2%，略高于18%的安全警戒线。2000—2006年粮食持续减产，粮食价格自2006年下半年持续上涨，不断突破历史高位，国际市场一片恐慌。为保障本国粮食供应及控制通货膨胀，各国纷纷出台限制出口、鼓励进口的关税措

^① <http://www.adb.org/>.

施。世界粮食库存已降至新低,仅能满足54天全球消费^①。

根据联合国粮食及农业组织(Food and Agriculture Organization, FAO)对全球176个粮食主产国的统计资料分析,1990年以来,世界粮食生产的长期趋势有两个重要特征:一方面,人均粮食产量持续增加的国家多于人均粮食产量减少的国家,粮食增产国家人均粮食产量增加的幅度也远远高于减产国家人均产量减少的幅度,世界粮食生产的增长速度在总体上快于人口的增长速度;另一方面,在能源短缺、价格不断上涨和世界经济动荡加剧等许多不确定因素的影响下,粮食生产成本快速上升,国际粮食贸易和市场价格波动剧烈,粮食安全风险在加大。因此我们知道:2007年中期开始的新一轮国际粮食价格超常规大幅度上涨,是能源大幅度涨价导致粮食生产成本增加、金融市场的炒作、生物能源对粮食的消耗和一些国家对粮食贸易的限制等因素综合作用的结果,其中,能源价格上涨和金融市场炒作则是关键性因素。

与过去的30年相比,世界粮食市场价格已经大幅抬高,粮食市场平均价格将很有可能长期在高位波动运行。我国是世界第一人口大国,毫无疑问,粮食是国民经济健康发展的基础。就我国粮食市场而言,粮食价格对我国粮食生产领域内资源配置起着非常关键的作用,不仅影响着粮农对农业生产的投入和生产要素所有者的收入,而且还对国内粮食供给起着重要作用。因此,粮食价格对我国粮食安全、保证农民增收乃至整个宏观经济的平稳运行都起着至关重要的作用。

改革开放以来,随着计划经济体制逐渐向市场经济体制转轨,粮食价格的形成不断市场化,影响粮食价格的因素也日益增

① 全球背景下的中国粮食安全状况与应对 [EB/OL]. [2008-03-21]. http://news.xinhuanet.com/world/2008-03/21/content_7832283-3.htm.

多并复杂化，其波动越来越明显。自 20 世纪 90 年代以来，我国的粮食市场价格发生了剧烈的波动。20 世纪 90 年代初期，粮食市场出现了改革开放以来的第二次相对过剩，到了 1993 年、1994 年市场粮价大幅上升，仅仅在两年时间内，市场粮价便由谷底上升到周期峰值，完成了粮食供求变化的一次周期^①。紧接着从 1995 年粮食紧缺高峰之后粮食产量开始连年增长，1998 年粮食产量达到历史最高峰，市场粮食价格陷入低谷。2000 年以后粮食连续 4 年减产，粮价于 2003 年 10 月份开始上涨，在 2004 年达到周期顶点，从而完成了粮价变化的又一次周期。

粮食市场价格的波动给我国的粮食生产、粮食进出口和国家宏观经济调控带来了诸多不确定性。粮食价格的大幅上涨，一方面刺激农民增加粮食生产，另一方面也刺激粮商扩大粮食进口，而这个过程通常存在时滞，在粮食的有效市场供给增加以前，其价格仍会攀升。但粮食供求关系会逐渐由基本平衡达到相对过剩，保存过剩的粮食又需要占用一定的库存成本，显然，过高的粮食价格会造成生产资源的浪费。当粮食供给达到相对过剩后，粮价开始下降，促使农民减少粮食生产，粮商也会减少粮食进口，使粮食市场的有效供给减少，不利于维护我国的粮食安全。在市场粮价波动的过程中，谷贱伤农，并且经常出现粮价上涨而农民得不到实惠、粮食流通领域赚取大量利润的现象，不利于粮食生产者形成稳定的预期，降低了农民的收入和从事农业生产的积极性，减少了农业生产的经济效益和农业的生产投入，这对稳定粮食生产供给非常不利。此外，市场粮价大幅波动对城市低收入群体的基本生活也产生了较大的影响，同时也加剧了政府对粮食市场进行宏观调控的难度，影响着我国的粮食安全和国民经济

① 卢峰. 半周期改革现象 [M]. 北京: 北京大学出版社, 2004: 4-5.

的健康发展^①。粮食价格的变化受很多因素的影响，一切影响粮食供给、粮食需求和粮食流通的因素都可能引起粮食价格的变化^②。我国粮食需求的波动较小，对于粮食产量起调节作用的主要是真实粮价，而真实粮价取决于名义粮价和通货膨胀两个方面，即真实粮价的波动不仅取决于粮食市场本身的供求因素，而且通货膨胀率的变动构成了粮食市场波动的一个重要的外部冲击因素。但是，国内已有的研究多关注于粮食供给和粮食需求对粮食价格的决定作用，而忽略了对通货膨胀这一重要因素的研究。

1.1.2 研究意义

粮食资源是支撑人类社会生存和发展的最基本的战略物资，获得充足且高质量的粮食是每个公民最基本的权利。但由于人口增长和资源稀缺的矛盾，以及一些长期影响世界粮食供给的因素的存在，粮食安全问题逐渐成为影响人类可持续发展的关键，保证与经济和人口增长速度相适应的粮食供给成为各国政府亟待解决的问题。

在市场经济条件下，价格机制是最重要的调节机制，合理的价格政策是协调生产者、经营者与消费者之间的利益的有效杠杆。当前我国粮食商品市场存在的主要问题是市场粮食价格既难以反映粮食商品的价值，又难以平衡粮食产业和其他产业之间的利益关系。因此深入研究我国市场粮食价格波动状况，对于认识粮食价格波动的规律，减轻市场粮食价格波动对我国农民收入、农业发展和国民经济的负面影响，保持与我国经济社会人口发展相适应的稳定的粮食生产，提高农民收入水平和农业经济效益有

① 尹成杰. 关于我国粮食生产波动的思考及建议 [J]. 农业经济问题, 2003, (10): 4—9.

② 高鸿业. 西方经济学 [M]. 4版. 北京: 中国人民大学出版社, 2006.

着深刻的现实含义。同时,深入研究粮食价格波动的宏观经济背景和经济规律,可以为市场经济条件下研究我国粮食的供求关系、粮食购销市场化改革和粮食流通管理问题提供一个崭新的视角,对于科学理解市场化条件下粮食安全也有一定的借鉴意义。

通过研究粮价的形成机制,认识影响粮食价格的各因素之间的关系,将直接关系到我国重大政策的决策问题,以及宏观治理问题 and 经济过热问题。此外,对保障粮食的合理供给、解决“三农”问题、促进农村经济的发展、保障国民经济协调发展至关重要。因此,研究与粮食有关的问题特别是粮食价格问题,对我国社会经济发展具有重要的理论意义和实践意义。

首先,探讨我国粮食价格波动问题具有重要的理论意义。自改革开放以来,我国的综合实力在不断增强,工业、商业以及城市经济整体实力都有了长足的进步,农业经济也取得了较大的发展。在同一时期,有关农作物价格研究以及农业经济的各种理论方法也得到了较大程度的完善和提高,粮食经济理论作为农业经济的主要组成部分,其研究成果不断取得有价值的进展。自2000年以来,新的市场环境和国际形势冲击着我国粮食市场,因此,必须有适应新条件的理论和方法来指导我国农业经济及粮食市场的有序发展。本书对我国粮食供求状况、粮食价格的波动情况、影响粮食价格波动的因素等问题进行了深入的研究,并试图为补充和完善粮食经济理论提供有效的内容。

其次,对粮食价格问题的分析研究具有重要的实践意义。我们有必要对社会经济生活中众多有关粮食生产供给和粮价问题进行深入探讨。比如:利用什么样的方法才能保证充足的粮食供给?如何有效调整粮食的供需平衡?如何把粮食价格的波动控制在较小的范围内?如何保障农民的经济利益并提高种粮积极性?通过哪些措施能够保证国家的粮食安全?希望通过本书的探讨研究,能在一定程度上针对实现国家粮食供求平衡、控制粮食价格

波动，为国家决策部门提供合理有效的建议。

1.2 相关概念界定

1.2.1 粮食概念的界定

(1) 我国常用的粮食概念。

根据我国传统习惯，粮食的概念有狭义和广义的区别。狭义的粮食是指谷物类，即禾本科作物，主要有稻谷、小麦、大麦、高粱等。广义的粮食不仅包含谷物类，而且还加入了豆类、薯类。广义的粮食概念的由来，是由于新中国成立初期我国粮食产量不高，实行政府计划控制的统购统销政策，从而把豆类和薯类等有利于提高粮食的统计产量和实现人民温饱水平的农产品也加入粮食概念中统一计量，以保障居民人人都有饭吃的权利。因此，从1953年起，国家修改农业统计口径，每年公布的粮食产量均采用广义的粮食概念。

(2) 联合国粮食及农业组织界定的粮食概念。

联合国粮食及农业组织界定的粮食概念，主要是指粗粮、豆类、麦类以及稻谷类等谷物。详细谷物产品目录有8种，即豆类、麦类、稻谷类、粗粮（包括大麦、玉米、黑麦、燕麦、高粱）。我国因为翻译的习惯，常将联合国粮食及农业组织公布的世界谷物总产量译成世界粮食总产量。其实，这个“世界粮食总产量”只是指谷物，不包括豆类和薯类。鉴于我国的粮食概念与世界粮食概念存在区别，故而联合国粮食及农业组织在对我国谷物库存量进行估算时，产量都会比实际库存更高。在本书的研究中，采用广义的粮食概念。

1.2.2 我国粮食价格的界定

由于我国经济体制的不断改革与发展,我国的粮食价格体系也随着粮食价格政策的变化而逐步演变成具有许多价格形式的非常复杂的体系。我国粮食价格政策的表现形式先后有:自由购销时期(1949—1952年),主要由市场形成粮食价格;统购统销时期(1953—1985年),主要由政府制定价格,即单轨制;合同定购和议购议销时期(1985—1993年),这一时期政府定价和市场定价并存,即双轨制;放开统销和多种价格并存时期(1993—2003年),在这一时期影响粮食价格的因素较多,粮食价格形成机制多元化;购销市场化时期(2004年开始),近几年我国的粮食价格主要都是由市场供求关系和价值规律决定的。

政策价格是指国家政府为了宏观经济的整体调控效果或出于某种特定的需要,或者根据某种国际通行标准所制定的价格。它不受市场供求关系的影响。统一收购价格、统一销售价格、国家定购价格、超购价格以及专储收购价格等都是我国新中国成立以来出现过的粮食政策价格表现形式。

统购统销价格是国家对粮食实行计划收购、计划供应和计划分配所统一制定的价格,是我国在当时的历史条件下为保障必要的粮食供给、处理国家同农民的关系的政策。超购价格实质上一种奖励办法,即政府对农民超过政府下达的收购计划基数部分出售的粮食加价收购。粮食的超购价格是统购价格加上奖励部分,也是政府在当时为了鼓励农民扩大生产、增加产量的措施。粮食定购价格是1985年我国取消了对粮食的统购,改为实行合同定购,定购的价格仍由国家确定,根据三成按原统购价、七成按原超购价的原则形成的价格。

议购议销价格是指在政府粮食政策的前提下,根据粮食市场供求量的情况,参照事先议定的价格,由国营粮食商业企业和其

他粮食商业企业共同经营粮食的销售和流通形式而形成的价格。这种价格的升降,主要取决于市场粮食供求状况和参照价格的变化。国家一般通过对粮食议购价格规定最低保护价和最高限价,或者对规定经营议销粮食企业的利润水平进行干预,同时可以通过控制国营粮食企业的吞吐调剂控制议价水平。

国内市场粮食价格一般是指固定有形的城镇或有代表性的乡村农产品批发市场或零售交易市场的价格或是两者的平均价格。在统计我国粮食市场价格时,一般以一些典型活跃的大中城市粮食市场的价格作为代表。

国际市场价格包括离岸价格和到岸价格。对出口粮食作物或副产品一般常用离岸价格,对进口品一般采用到岸价格。因为运费、保险费的差异,对离岸价格和到岸价格的界定,有助于研究我国农民及粮食企业出售粮食所获得的实际收入。

改革开放 30 多年来,我国农业和农村经济取得了巨大的发展,同时也存在不少问题。随着市场化改革的不断深化,在向市场经济体制过渡的进程中,我国农业和农村经济改革正处在具有重大历史意义的阶段,市场经济体制将占据粮食市场,粮食价格将逐渐由价值规律和供求关系自发形成,不稳定性也将不断增大。因此,粮食价格体系中的市场价格必然是政府调控的目标和重点。本书选择国内粮食市场价格作为粮食价格波动的主要研究对象。

1.2.3 粮食价格波动的概念

粮食供求关系和价值规律作用是粮食价格波动的最直接原因。虽然很多原因都会引起粮食价格波动,但就粮食价格形成本质因素而论,市场供求关系的矛盾、农作物生产成本的推动、自然灾害因素以及国际市场价格的波动传染等因素是引起粮食价格波动的最主要原因。粮食价格波动会对下一季粮食生产规模、农

民实际收入和国民经济整体市场价格水平产生巨大的影响。要控制粮食价格波动的幅度,就应从整体上提高我国粮食生产的技术水平、增强粮食的综合生产能力、对价格服务体系加以提高和完善,并建立起良好的粮食价格调控体系和加强政府部门对粮食市场的价格监管。

1.2.4 粮食安全的概念

从20世纪70年代以来,世界银行以及欧美等发达国家和组织的专家都对粮食安全的概念进行了很多的探讨。到目前为止,粮食安全的定义至少有百种以上^①。关于此概念,大多数学者比较赞同联合国粮食及农业组织(FAO)所下的三次定义。1974年11月FAO对粮食安全的定义为“保证任何人在任何地方都能得到为了生存和健康所需要的足够食品”,并确定最低安全水平系数为当年库存或至少相当于次年消费量的17%~18%;1983年4月FAO对粮食安全的定义为“确保所有的人在任何时候能够买得到也能够买得起他们所需的基本食物”;1996年11月在第二次世界粮食首脑会议上,FAO对粮食安全的定义作了新的表述:“只有当所有人在任何时候都能在物质上和经济上获得足够、安全和富有营养的粮食,来满足其积极和健康生活的膳食需求及食物爱好时,才实现了粮食安全”。

国内外学者围绕FAO对粮食安全概念的定义,结合他们所了解的实际情况,又从多个不同的角度提出了自己的见解。经济学家阿尔托·瓦尔德斯(Alberto Valdes)将粮食安全定义为“缺粮国家或这些国家的某些地区或家庭逐年满足标准消费水平

^① Maxwell. Alternative Food Security Indicator: Revising the frequency and Severity of Coping Strategies [J]. Food Policy, 1999: 411-429.

的能力^①”。

朱泽则认为当今中国所面临的粮食安全问题，无论就其背景还是性质而言，都不同于一般的发展中国家，更不同于发达国家，因此不能直接套用FAO给定的概念。同时，他只针对中国的具体粮食现状，总结出了自己关于粮食安全的概念：粮食安全是指国家在其工业化进程中满足人民日益增长的对粮食的需求和粮食经济承受各种不测事件的能力。他着重强调三点：第一，粮食安全从本质上讲，是指一个国家抵御粮食经济中可能出现的各种不测事件的能力；第二，粮食安全反映了一个国家在一定的经济发展水平和人均GNP水平下的粮食供给与消费的能力；第三，中国现代化的核心是实现工业化，研究及改进粮食安全状况的目的是为了推进中国的工业化进程^②。

21世纪初，由于可持续发展观念的影响，粮食安全内涵进一步拓展到无污染、无公害、绿色安全的范畴。粮食生态安全成为粮食可持续发展的基础。2001年世界粮食安全大会提出，“所有人在任何时候都能够在物质上和经济上获得足够富有营养和安全的食物”。由此不难看出，粮食安全的含义很丰富，我们可以从以下几方面进行把握：

第一，粮食安全是一个不断丰富深化的动态概念。由粮食安全的演变历程，我们可以看出粮食安全概念是一个由低级到高级、由不完善到比较完善、由片面到全面的动态发展过程。现代粮食安全概念包括数量安全、质量安全和生态安全三层内涵，即：既要保证粮食充足的数量供应，而且还要卫生健康、营养全面，并且粮食的生产还要保证生态环保、可持续发展。

① Maxwell. Alternative Food Security Indictors: Revising the frequency and Severity of Coping Strategies [J]. Food Policy, 1999 (24): 411—429.

② 朱泽. 中国粮食安全：政策研究与实证分析 [D]. 北京：中国农业科学院农业经济研究所，1996.