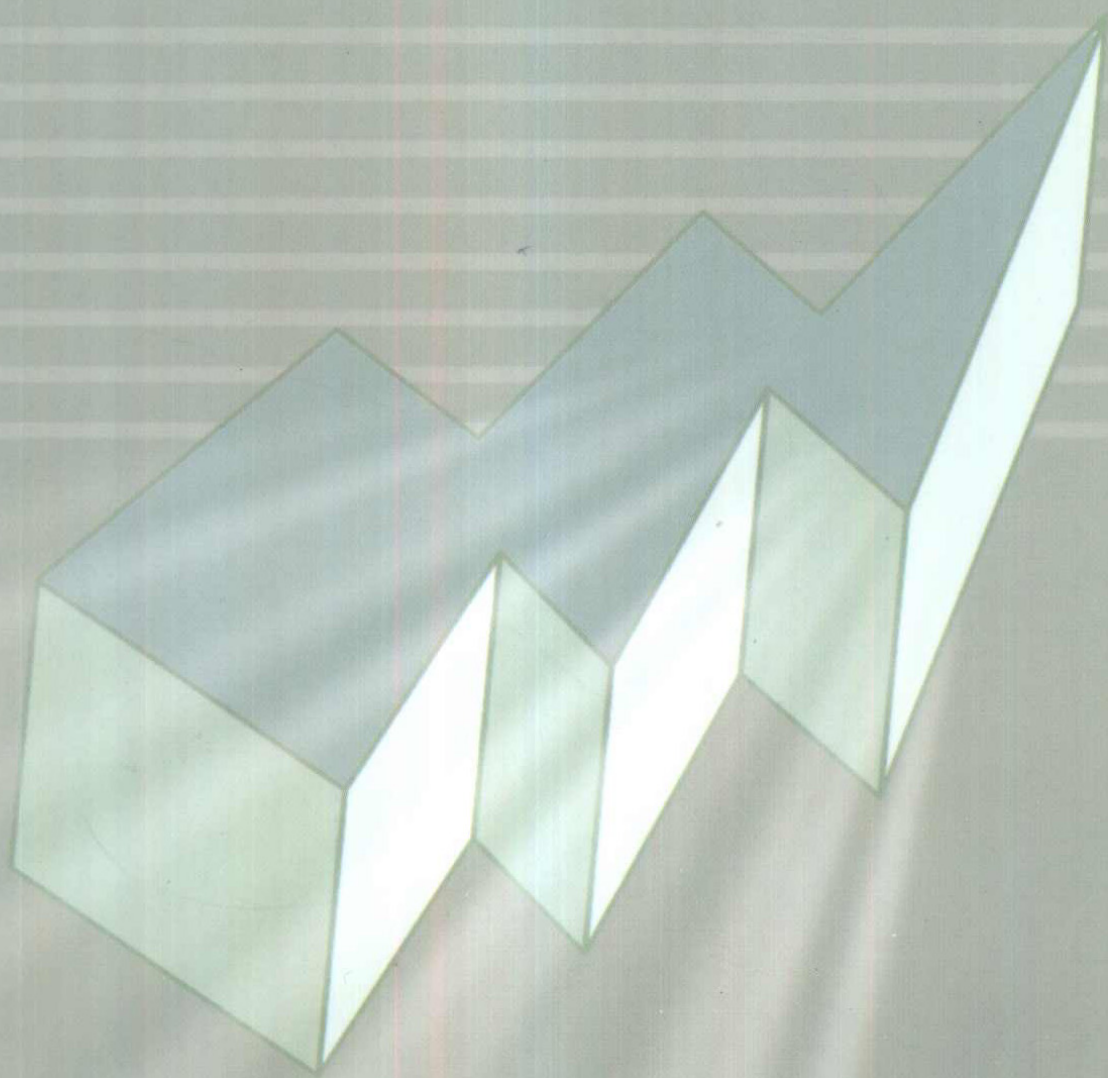


中国农产品市场行为研究

BEHAVIOR OF CHINA'S AGRICULTURAL PRODUCT MARKET

武拉平 著



中国农业出版社

875

1. 2000
1. 2000

武拉平/著

中国农产品市场行为研究

BEHAVIOR OF CHINA'S

AGRICULTURAL PRODUCT MARKET

中国农业出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

中国农产品市场行为研究/武拉平著. — 北京: 中国农业出版社, 2002. 9

ISBN 7-109-07830-2

I. 中... II. 武... III. 农产品-市场-研究-中国
IV. F724.72

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2002) 第 055222 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 100026)

出版人: 傅玉祥

责任编辑 赵 刚

中国农业出版社印刷厂印刷 新华书店北京发行所发行

2002 年 9 月第 1 版 2002 年 9 月北京第 1 次印刷

开本: 850mm×1168mm 1/32 印张: 6.75

字数: 163 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)

内 容 摘 要

在 20 世纪 90 年代初,中国曾出现了一场对市场经济的大讨论,关于市场的研究成为当时的热点。10 年后的今天,当历史的车轮步入 21 世纪,面对国际国内经济环境的变化,特别是中国“入世”,国内外又出现了对中国经济市场化的讨论。但与 10 年前不同的是,这场讨论更多的是集中在国外。1999 年美国国际农业贸易与研究协会在旧金山举行了“中国农业贸易与政策”国际研讨会,重点讨论中国“入世”与农产品市场和贸易;2001 年 5 月在法国克莱蒙-菲朗举办了“中国经济市场化”国际研讨会;2001 年 6 月澳大利亚国际农业政策研究中心在江苏昆山举办了“中国粮食市场化”研讨会。实际上,道理很简单,如果对中国的市场状况不了解、对市场行为不了解,那么就很难谈得上有效地进入中国市场,这是国际上诸多国家关注中国市场和研究的根源。就国内而言,中国“入世”实际上也就是要按照 WTO 的规则、按照市场经济的规则参与到全球市场经济的竞争中,如果不首先了解中国市场的行为的话,那么任何对“入世”利弊的分析都将缺乏基础、缺乏科学性。总之,对中国农产品市场行为的研究,已成为摆在我们面前的重要的和紧迫的课题。

本书共八章,第一章介绍了农产品市场行为的有关理论问题。本章首先从“市场研究”和“行为研究”两个角度分别进行分析,然后将两者结合起来构建了“市场行为”的研究框架。

第二章在综合分析目前国际上常用的有关市场研究方法的基础上,提出了一种市场行为分析的“三步法”,第一步是市场之间本质联系的检验,第二步是市场变化的先后(“因果”)关系检验,第三步是市场之间联系紧密程度的测量。另外,书中还介绍了市场价差的理论与方法,用来分析收购、批发和零售环节之间的关系。

第三章详细阐述了农产品市场和贸易的发展变化。首先介绍了农产品市

场与价格的历史演变，对中国的农产品价格体系进行了总结。同时，本章还对中国粮食市场体系和粮食流通以及农产品贸易体制及其改革进行了系统介绍。这些是掌握中国农产品市场行为本质的基础。

第四章通过统计分析方法，系统研究了农产品价格的地区波动行为。分析表明当农产品价格发生波动时，其主产地的价格最后变化。另外，分析也表明今后一段时间内东南沿海地区仍然随时可能成为我国农产品价格上涨的导火线。

第五～七章为全书的核心部分，在这三章中运用市场行为分析“三步法”对国内各地方农产品市场间行为、农产品收购、批发和零售市场间行为以及国内农产品市场之间的行为进行了实证分析。其中，第五章对国内各地农产品市场间行为关系进行了实证研究。认为小麦和玉米收购市场均长期整合，但短期整合关系则不存在，生猪收购市场长期整合较差，但短期整合情况好于小麦和玉米。从市场联系紧密程度来看，各地玉米市场之间联系的紧密程度较差，而小麦市场的联系紧密程度较大。本书还总结了农产品收购价格地区波动规律。第六章是对农产品收购、批发和零售市场间行为关系的研究。认为粮食市场收购、批发和零售之间存在内在的稳定的关系。其中，零售价格主要受批发和收购价格的影响，批发市场主要受其主产区的收购价格的变化影响。第七章，对国内外农产品市场之间的行为关系进行了实证研究。结论为：国内玉米批发价格变化领先于国际市场。中原地区的郑州粮食批发市场小麦价格的变化领先于国际小麦市场，而南方地区的湖北粮食批发市场小麦价格变化则受国际市场的影响。大米、大豆、花生油和生猪市场，均为国际市场价格变化领先于国内市场。另外，总体而言，国内玉米批发市场与国际市场联系程度最大，生猪和花生油批发市场与国际市场联系程度最小。

第八章为全书小结，对农产品市场行为领域需要进一步研究的问题进行了简单评述，包括不同市场行为差异的原因、不同粮食政策对市场行为的影响、不同粮食品种的特点对市场行为的影响等等。

本书的读者对象主要为科研机构 and 高等院校从事农产品市场和价格研究人员、各级政府部门的领导和政策制定者，也可作为高等院校师生的教学参考书。

Abstract

There was a hot discussion about China's market economy at the beginning of 1990s. After about 10 years, there raised another hot discussion about China's market. However, different from the before, this discussion was mainly raised out of China. In June 1999, an international conference about China's agricultural trade after entering WTO was held in San Francisco, it mainly focused on China's market. In May 2001, another conference was held in France, which focused on China's marketization. In June 2001, Australian Center of International Agricultural Research held a conference about China's grain market reform. These show that, in order to expand their market, many countries have paid many attentions on China's market behavior.

However, there are not many researches about market behavior in China. Without the detailed research about China's market, it is difficult to coordinate with world market efficiently and effectively. This book aims at improving the research about China agricultural market behavior.

This book is divided into eight chapters. Based on the introduction of market research and behavior research, the first chapter describes the theories about market behavior. The second chapter introduces the major methods about market research, and constructs a three-step method to study the market behavior. First step is the market integration test, the second step is the market causality test, and the last step is to measure the market connection. In this chapter, the marketing margin theory is also discussed; it will be used to analyze the relation among farmgate, wholesale and consumer prices.

As the background of China's agricultural market reform, the third chapter introduces the development of China's agricultural market and trade. It includes three parts, they are agricultural market and price history, agricultural market

system and trade system. These are basis of further research about market behavior. By statistical method, chapter four analyzes the price fluctuation across regions.

The core part of this book includes chapter 5 ~ Chapter 7. In these three chapters, the three-step method is used to do empirical research about relation of regional farmgate markets, relation of farmgate, wholesale and retail markets, and relation of domestic and world market. Chapter 5 is about relation of regional farmgate markets. This research shows that there exists long run integration for wheat and maize markets, but the short run integration doesn't exist. The case of hog markets is different, short run integration exists, long run integration doesn't. Meanwhile, compared with maize markets, the regional wheat markets are more closely connected. This chapter also analyzes the rules of agricultural product price fluctuation across regions.

The study of Chapter 6 on the relation among farmgate, wholesale and retail agricultural markets shows that there exist long run integration from farmgate to retail markets. The causalities are as followings, farmgate price lead wholesale prices, farmgate and wholesale prices lead retail prices.

The relation between domestic and world markets is studied in Chapter 7. The results show that domestic maize wholesale price lead world price, wheat wholesale price in central China lead world wheat price, but in the south areas the wheat wholesale prices are caused by world wheat price. The wholesale markets of rice, soybean, peanut oil and hogs, no matter in north or south areas, are all caused by world markets. In terms of market connection, domestic maize markets are closely connected to world market, but the degree of market connection for hogs and peanut oil is very low.

Chapter 8 is the final remarks, some issues needed to be studied are discussed, including the reasons of different market behavior, the influences of different policies on market behavior and the influences of different grain types on market behavior, etc.

This book is primarily targeted at an audience that includes policy makers, agribusiness leaders and research and teaching communities.

前 言

在本书中所记述的研究工作是由福特基金会支持的公共政策研究资助竞争项目资助的。在这个改革时期，政府职能的转换为中国公共政策的形成提出了新的挑战。随着政府逐渐从经济单元中退出其直接管理，其角色也逐步转向对经济环境和公共物品及服务提供的管理上。因此，良好的公共政策的形成就需要政府官员、研究人员和那些受政策发展影响的群体之间形成一种新型的互动模式。

公共政策研究资助竞争项目是于 1998 年开始支持研究人员和政策制订者们从事分析特定的政策问题及公共政策形成方法的。最终的优胜者是由国内外高级经济学家和社会学家组成的委员会经过严格的评审后决定的。我们福特基金会为中国有这么多学者愿意致力于有关中国当代公共政策应用问题的研究而感到高兴。

研究只有在被沟通和理解后才能为政策的决定提供依据。因此，福特基金会同样通过该竞争项目赞助出版其中一些优秀的研究成果。在此，我们祝贺在本出版物中发表自己著作的学者，并非常高兴能使其研究成果获得更多公众的了解。

Sarah Cook
福特基金会北京代表处

关于本书

本书为作者完成的福特基金会资助的“中国公共政策研究项目”的两个科研课题成果，一个是2000年完成的“主要农产品国内外市场整合程度研究”，另一个是2001年完成的“中国粮食收购、批发和零售市场的协调及市场建设研究”。在这里，作者首先感谢福特基金会给予的研究资助和本书的出版资助。

中国公共政策研究竞争项目，是1999年11月为了庆祝福特基金会中国办公室成立十周年，而设立的一项每年一次资助中国公共政策研究的竞争性项目。该竞争项目旨在支持中国学术界从事与当代中国公共政策相关的高质量的课题研究，最终使学术界与政策决策者之间建立更加密切的联系。这种联系将确保使用严密的方法和利用高质量的数据得出的研究结果，能够真正有助于中国的政策决策者和实施者。

中国公共政策研究竞争项目的选拔是很严格和公正的，它经过国内外专家的多轮选拔，最后经过预选人员和国内外专家评委的直接面谈，从而确定最终的资助人选。我非常荣幸能够连续两次获得福特基金会的资助，这是国内外专家对我所从事研究的肯定，也说明自己的研究对中国的公共政策有一定的借鉴意义。因而在完成了全部两个课题后，我又提交了福特基金会出版资助的申请，并得到批准，因此才有了大家面前的这本书。当然，书中可能还存在一定的不妥之处，恳请大家批评指正。

目 录

第一章 农产品市场行为的有关理论问题	1
一、“市场行为”研究思想的形成	1
二、关于“市场研究”	4
三、关于“行为研究”	6
四、关于“市场行为”	10
第二章 农产品市场行为的分析方法	18
一、市场之间的本质关系：市场行为的基础	19
二、市场行为分析“三步法”	25
三、市场价差的理论与方法	34
第三章 农产品市场和价格的发展变化	38
一、农产品市场与价格的历史演变	38
二、中国粮食市场体系和粮食流通	48
三、农产品贸易体制及其改革	53
第四章 农产品价格的地区波动行为	57
一、样本的选择	57
二、农产品价格的地区差异	64
三、区域差异的分析结论	70
第五章 国内各地方农产品市场间的行为关系	73
一、研究背景及有关说明	73
二、研究方法模型及运算结果	77

三、各地农产品市场本质关系的基本判断与政策建议·····	93
第六章 农产品收购、批发和零售市场间的行为关系·····	102
一、研究背景及相关说明·····	102
二、样本选择·····	105
三、粮食收购、批发和零售市场的内在关系·····	107
四、粮食收购、批发和零售市场相互影响的 因果检验·····	109
五、粮食收购、批发和零售市场的价差分析·····	111
六、研究结论与政策含义·····	119
第七章 国内外农产品市场之间的行为关系·····	122
一、研究背景及概述·····	122
二、国内农产品批发市场与国际市场整合程度 的实证分析·····	126
三、国内农产品收购、零售市场与国际市场的 关系分析·····	140
四、主要农产品国内外市场关系的结论及政策建议·····	146
第八章 本书小结：需要进一步深入研究的问题·····	166
附录一 农产品流通政策大事记（1987—2001年）·····	168
附录二 附表 1~14·····	175
附录三 附图 1~10·····	185
参考文献·····	192
后记·····	199

Contents

Chapter 1 Theories about Market Behavior	1
1 Research Ideas about Market Behavior	1
2 About Market Research	4
3 About Behavior Research	6
4 About Market Behavior Research	10
Chapter 2 Analysis about Market Behavior	18
1 Relationship between Markets is the basis of Market Behavior	19
2 Three-step Research about Market Behavior	25
3 Theory and Methodology about Marketing Margin	34
Chapter 3 Agricultural Product Market and Price of China	38
1 Agricultural Product Markets and Prices	38
2 China's Grain Market System and Domestic Trade	48
3 China's International Trade System and Reform	53
Chapter 4 Regional Price Behavior of China's Agricultural Product	57
1 Samples	57
2 Price Differences across provinces	64
3 Conclusions about Regional Price Differences	71

Chapter 5 Relations among Local

Agricultural Markets	73
1 Research Background	73
2 Method and Results	77
3 Conclusions and Suggestions about Relations of Local Agricultural Product Markets	93

Chapter 6 Relation among Agricultural Purchase,

Wholesale and Retail Markets	102
1 Research Background	102
2 Samples	105
3 Integration of Agricultural Purchase, Wholesale and Retail Markets	107
4 Causality of Agricultural Purchase, Wholesale and Retail Markets	109
5 Marketing Margin from farmer to retailer	111
6 Conclusions and Suggestions	119

Chapter 7 Relation between Domestic

and World Agricultural Markets	122
1 Research Background	122
2 Integration of Domestic Agricultural Wholesale Markets and World Agricultural Markets	126
3 Relation among Domestic Farmgate Prices, Retail Prices and World Market Prices	140
4 Conclusions and Suggestions	146

Chapter 8 Summary: Some issues to be studied 166 |

目 录

Appendix China's Domestic Trade Policy of Agricultural Products from 1987 to 2001	168
Appendix Table 1 ~ Table 14	175
Appendix Figure 1 ~ Figure 10	185
References	192
Postscript	199

第一章 农产品市场行为的 有关理论问题

一、“市场行为”研究思想的形成

谈起我对“市场行为”研究的最初设想，首先要从我对农产品市场的研究开始。我对农产品市场的专门研究，始于我攻读博士学位之时。当时，我非常高兴能够考取中美联合培养的“温洛克”农业经济学博士^①，我的中方导师为农业部农村经济研究中心主任柯炳生教授（时任中国农业大学副校长），美方导师为加利福尼亚大学（Davis）农业问题研究中心主任 Daniel Sumner 教授。我的博士研究方向为农产品市场与政策。1996 年，我与导师柯炳生教授商量博士论文的选题时，导师高瞻远瞩建议我做市场一体化（即市场整合）和比较优势方面的研究，考虑到自己时间和精力限制，我没有将市场一体化与比较优势结合起来分析，而将

① Winrock 农业经济博士项目（即 LEAD21 项目），由美国 Winrock 国际农业发展协会与中国 12 家具有农业经济博士学位授予点的高等农业院校和研究所联合举办，旨在为 21 世纪中国的农业经济领域培养一批教学和科研骨干，为中国农业迎接 21 世纪的挑战培养一批带头人。博士课程的教学完全按照美国大学农业经济博士课程的教学计划而设计，采取全日制教学，课程学习时间为 1996 年 6 月至 1998 年 6 月。1998 年 6 月至 1999 年 6 月，完成博士论文的写作与答辩。国内 12 家单位包括：中国农业大学、中国人民大学、中国社会科学院、中国农业科学院、南京农业大学等。学生由上述 12 家院校（研究所）推荐，经美国 WINROCK 协会组织考试小组考核录取。

教授来自国际各大著名院校，包括美国芝加哥大学的 D. Gale. Johnson 教授，加利福尼亚大学（Davis）的 Daniel Sumner 教授和 Scott Rozelle，美国杜克大学的 D. Wallace 教授，美国斯坦福大学的 Scott Pearson 等，另外还有明尼苏达大学、奥本大学、密歇根大学、台湾大学等 20 多位著名教授承担课程讲授任务。在博士学习的三年中，来自中央财经领导小组、中国农业部、美国农业部、美国多所大学、澳大利亚国立大学和悉尼大学、新西兰梅西大学、马来西亚农业大学以及国内多所大学的 26 位专家教授作了专题讲座。

博士论文选题定为“中国主要农产品市场整合程度研究”，重点研究国内各地主要农产品收购市场的整合分析。

在论文写作过程中，我的美方导师 Daniel Sumner 教授多次专程来北京指导我的论文写作。另外，在博士论文的写作过程中，我也多次与我院田维明教授探讨市场整合的有关问题，并向田维明教授咨询以后进一步扩大市场整合研究范围的可行性。在博士论文答辩完成后，适逢福特基金会开始资助“中国公共政策研究”的竞争项目，因而我在自己博士论文的研究基础上，提交了一份项目申请，计划运用有关市场整合的方法对“国内外主要农产品市场的关系”，包括两者之间是否存在本质的联系（即整合情况）、两者相互影响的因果（先后）关系以及市场之间联系的紧密程度进行系统深入的研究。非常荣幸的是我的项目建议书得到了福特基金会国内外专家的批准，因而在 1999 年下半年，我开始了国内外农产品市场关系的研究。

还在我提交上述 1999 年的项目建议书之时，又一个想法在我脑海中形成，那就是下一个研究我将集中在对“收购、批发和零售市场”之间的整合程度及市场价差的分析方面。在一年之后，即 2000 年 8 月，当我完成 1999—2000 年福特基金会公共政策项目“国内外主要农产品市场的关系”后，我又提交了第二份申请，即关于“收购、批发和零售市场的关系及市场建设研究”。令我非常感动的是，在相当激烈的竞争项目的申请中，我的建议又得到专家的认可。2000 年下半年，受福特基金会的资助，我又开始了有关收购、批发和零售市场之间关系的研究。这时，我告诫自己一定要做好此研究，我也没有理由不好好完成此研究项目。而且，此时我也萌发了将来要把前面完成的项目综合起来的念头。因为此时自己有关“市场整合”的研究，已经涉及“水平整合（即空间市场整合）”和“垂直整合”，包括了：① 国内各地农产品市场之间的关系；② 国内和国际市场之间的关系；③ 国内收购、批发和零售市场之间的关系。

2001 年福特基金会又设立了出版基金，对公共政策研究项目的部分优秀成果给予资助出版。我的申请再次得到批准，并着手对自己完成的两个项目进行综合，从而一起结集出版。这时，我首先想到的是“中国农产品市场行为研究”这个书名，使用这个书名，主要基于以下两方面的考虑：

一方面，行为学是一门比较成熟的学科，而且行为学向其他学科的延伸和交叉也越来越快，包括向管理学领域和经济学领域的延伸（关于此部分内容参考本章下面部分）。但是行为学向市场领域的延伸还不足，特别是还没有完整的关于“市场行为”或“市场行为学”的专门研究。如果说本书有所居心的话，那就是也试图通过此书唤起大家对“市场行为”或“市场行为学”的研究。

另一方面，对于市场行为的研究，有着重要的现实意义。众所周知，目前全球经济一体化的趋势不断加强，国内市场化改革也在不断加快，特别是在中国加入 WTO 的情况下，越来越多的人对中国的市场状况表现出极大的关注。1999 年，由美国国际农业贸易与研究联合会在旧金山举办了“中国农业贸易和政策：观点、分析和全球影响”的国际研讨会，2001 年 5 月法国 Auvergne 大学举办了“中国已是市场经济了吗？”的国际研讨会，2001 年 6 月澳大利亚国际农业研究中心（ACIAR）和澳大利亚国立大学等单位在上海举办了“中国粮食市场化改革研讨会”。在参加上述这些国际研讨会的过程中，我也逐渐认识到：对中国经济市场化改革的众多关注，其核心都归结到中国的“市场”状况的研究。如果对中国市场的运行状况、市场的行为不能有深入了解的话，那么如何谈起“中国市场与国际市场接轨”、如何研究“中国市场与国际市场的相互影响”等本质关系呢？

中国“入世”实际上也就是要按照 WTO 的规则、按照市场经济的规则参与到全球市场经济的竞争中，如果不首先了解中国市场行为的话，那么任何对“入世”利弊的分析都将缺乏基础、缺乏科学性。总之，对中国农产品市场行为的研究，已成为摆在